

海富通富祥混合型证券投资基金
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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	海富通富祥混合
基金主代码	519134
交易代码	519134
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2016 年 7 月 27 日
报告期末基金份额总额	479,723,908.12 份
投资目标	本基金通过稳健的大类资产配置策略和个券及个股精选策略，在严格控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金为混合型基金，对债券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 70%。在此约束下，本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场风险收益特征及市场行为因素等进行评估分析，对固定收益类资产和股票资产等的预期风险收益进行动态跟踪，从而决定其配置比例。
业绩比较基准	中证全债指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×30%。
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。
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

§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)
1.本期已实现收益	25,959,498.16
2.本期利润	7,237,024.56
3.加权平均基金份额本期利润	0.0156
4.期末基金资产净值	628,258,688.09
5.期末基金份额净值	1.310

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。

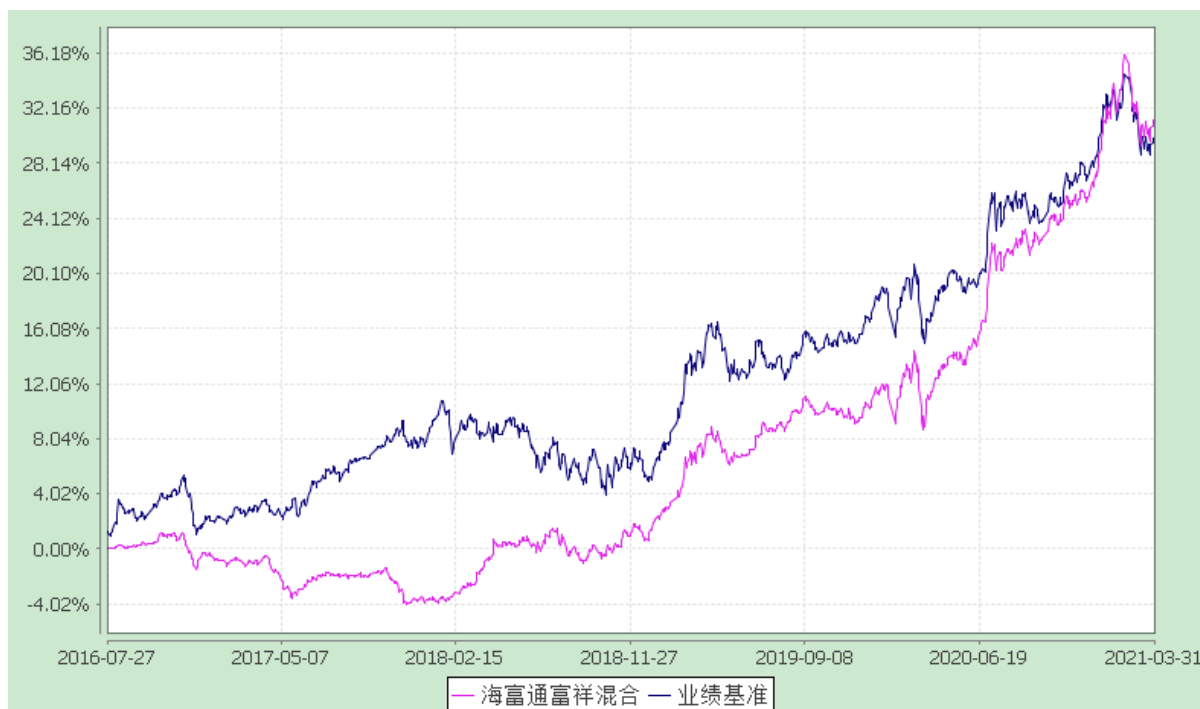
3.2 基金净值表现

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

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	1.71%	0.52%	-0.22%	0.49%	1.93%	0.03%
过去六个月	6.85%	0.41%	4.67%	0.41%	2.18%	0.00%
过去一年	17.81%	0.38%	11.18%	0.41%	6.63%	-0.03%
过去三年	32.99%	0.33%	21.56%	0.41%	11.43%	-0.08%
自基金合同生效起至今	31.00%	0.27%	29.70%	0.36%	1.30%	-0.09%

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

海富通富祥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历史走势对比图
 (2016 年 7 月 27 日至 2021 年 3 月 31 日)



注：本基金合同于2016年7月27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。

§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		
夏妍妍	本基金的基金经理	2019-10-29	-	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

					<p>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。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。</p>
朱斌全	本基金的基金经理	2019-10-15	-	13 年	<p>硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 7 月至 2006 年 8 月任上海涅柔斯投资管理有限公司美股交易员。2007 年 4 月加入海富通基金管理有限公司，历任交易员、高级交易员、量化分析师、投资经理、基金经理助理。2018 年 11 月起任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通富祥混合、海富通沪深 300 增强（原海富通富睿混合）、海富通量化多因子混合及海富通欣益混合的基金经理。2020 年 10 月起兼任海富通欣享混合、海富通新内需混合的基金经理。</p>

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出

决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准为：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。

本报告期，本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。

展望 2 季度，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，从经济基本面来看，2021 年第一季度国内经济延续修复趋势，1-2 月工业增加值同比增长 35.1%，较 2019 年同期增长 16.9%，两年复合增长 8.1%；受基数效应影响，一季度 GDP 同比增速或突破两位数。通胀方面表现分化，猪肉价格在基数效应以及产能逐步释放的情况下开启下行周期，CPI 有所走弱，但国内与海外经济恢复较好，原油等主要工业品以及原材料价格均有所上涨，2 月 PPI 同比回升 1.7%，创下 2018 年 12 月以来的新高。1 月中下旬资金由松转紧，而春节跨季之后资金面由紧转松，除了财政存款的季节性波动外，主因在于央行的精准调控，但总体上资金价格围绕 OMO 回购利率波动。在多空因素交织的背景下，一季度债市利率先上后下，债券总体仍未走出震荡格局。1-2 月受到流动性收紧，通胀预期大幅升温的影响，债市收益率一度上行，最高接近 3.3% 的阻力位。3 月以来市场对于经济以及通胀的预期趋于一致，且债券市场已对经济增长与通胀预期充分定价，市场表现为利空钝化，反而受到欧洲疫情反复，大

大宗商品价格波动的影响债市收益率转为下行，回到 3.2%左右的水平。整体看，一季度 1 年期国债收益率累计上行 10bp 至 2.58%，10 年期国债收益率累计上行 4.6bp 至 3.19%，期限利差较 20 年四季度有所收窄。信用债方面，短端表现优于中长端，收益率曲线陡峭化下行，中高等级短融信用利差压缩至历史极低水平。自永煤事件以来，信用债市场整体融资功能正逐渐修复，但是投资机构风险偏好未有本质提升，受永煤事件直接冲击的相关区域或行业融资仍难以恢复。可转债方面，一季度中证转债指数小幅下跌 0.4%。行业方面，钢铁、公用事业、银行涨幅较大；国防、非银、通信为跌幅前三。

一季度，本基金信用债配置从绝对收益的角度出发，精选中短久期、中高评级信用债个券。整体看，获得了稳定较高收益。

债券方面，二季度经济将延续修复，环比或进一步走强。一二月份欧美遭受新一波疫情冲击，经济数据是有所走弱的，随着疫情好转、美国万亿财政补贴发放，有利于出口，二季度本身经济活动存在季节性回升，再加上地产有韧性，消费有望继续改善，制造业投资回升可能性较高，经济复苏继续深化。通胀来看，在猪肉产能逐渐恢复，猪肉价格大概率有所下行，CPI 同比或偏弱；但 PPI 向上的压力仍不小，从同比上看二季度是个确定性的高点，但是回落的速度或较缓慢，当前随着原材料价格上涨，中下游也在涨价，但是尚未出现全面普涨现象，随着海外不断复苏，美国财政刺激落地，国际定价的原材料价格可能仍然比较坚挺，国内碳中和政策推进使得黑色系等仍偏强，意味着工业领域的普涨可能是迟早的，通胀的压力或持续较长时间。考虑到当前债市投资者对于基本面不确定性的分歧和当前健康的交易结构，债市整体或以震荡调整为主，但波动或加大，变盘的因素离不开经济基本面、通胀、供给、货币政策、资金面、监管、股债跷跷板等。而 4 月是货币政策的重要观察窗口期，4 月资金面受缴税以及财政投放的影响，资金缺口较大，资金面的波动将会明显加大，届时需重点关注央行的投放。此外二季度开始国债和地方债供给将明显增加，对资金面有一定的抽水效应。信用债方面，中短久期+高资质+防御型行业策略依然可为。在融资分层持续的情况下，信用风险可能维持高位，不宜过度下沉信用资质。转债方面，市场仍处于震荡区间中，波动缩窄。权益市场仍处于磨底阶段，多数行业并没有显著的方向。受到权益市场的影响，从行业角度看转债市场缺乏明晰的主线。从风格角度看，多数低价转债止跌回升，估值阶段性修复。转债市场目前已在一定程度反映出低价个券的估值改善、信用风险修复以及下修的影响，但若权益市场反反复复则低价个券空间有限。

二季度，本基金债券部分配置力求获得较好的票息收益。同时，积极关注利率债交易性机会，并配合股票部分投资策略，做好流动性管理。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通富祥基金净值增长率为 1.71%，同期业绩比较基准收益率为 -0.22%，基金净值跑赢业绩比较基准 1.93 个百分点。

4.6 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	144,949,933.89	23.03
	其中：股票	144,949,933.89	23.03
2	固定收益投资	461,755,867.34	73.36
	其中：债券	461,755,867.34	73.36
	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	8,000,000.00	1.27
	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	4,471,676.36	0.71
7	其他资产	10,251,990.68	1.63
8	合计	629,429,468.27	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	1,445,329.00	0.23
B	采矿业	3,536,537.00	0.56
C	制造业	91,539,783.92	14.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,997,548.12	0.32
E	建筑业	162,212.00	0.03

F	批发和零售业	2,035,895.82	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	465,977.20	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,783,273.69	0.76
J	金融业	27,835,446.64	4.43
K	房地产业	2,066,580.30	0.33
L	租赁和商务服务业	3,513,712.00	0.56
M	科学研究和技术服务业	2,733,078.00	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	22,939.20	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	149,301.00	0.02
Q	卫生和社会工作	1,255,816.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	1,406,504.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	144,949,933.89	23.07

5.2.2 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。

5.3 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	5,800	11,652,200.00	1.85
2	601318	中国平安	84,200	6,626,540.00	1.05
3	000858	五粮液	21,400	5,734,772.00	0.91
4	600036	招商银行	105,500	5,391,050.00	0.86
5	000333	美的集团	61,000	5,016,030.00	0.80
6	601166	兴业银行	189,000	4,553,010.00	0.72
7	002415	海康威视	67,600	3,778,840.00	0.60
8	000001	平安银行	141,564	3,115,823.64	0.50

9	601888	中国中免	9,700	2,968,976.00	0.47
10	000568	泸州老窖	12,300	2,767,746.00	0.44

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	49,698,351.60	7.91
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,150,000.00	1.62
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	137,050,000.00	21.81
5	企业短期融资券	100,159,000.00	15.94
6	中期票据	141,955,000.00	22.59
7	可转债（可交换债）	3,299,515.74	0.53
8	同业存单	19,444,000.00	3.09
9	其他	-	-
10	合计	461,755,867.34	73.50

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	101901369	19 金融街投 MTN001	300,000	30,315,000.00	4.83
2	155385	19 电控 01	300,000	30,249,000.00	4.81
3	019640	20 国债 10	286,210	28,609,551.60	4.55
4	101751006	17 招商局港 MTN001	200,000	20,548,000.00	3.27
5	101555014	15 商飞 MTN001	200,000	20,466,000.00	3.26

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。

5.8 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

本基金的股指期货投资以套期保值为主要目的，并选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或者空头套期保值。

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**

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

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

本报告期，本基金未参与国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

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

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	79,899.85
2	应收证券清算款	1,991,866.40
3	应收股利	-
4	应收利息	8,179,192.77
5	应收申购款	1,031.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,251,990.68

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	132021	19 中电 EB	285,120.00	0.05
2	113504	艾华转债	197,096.00	0.03
3	110043	无锡转债	179,244.20	0.03
4	113508	新风转债	178,963.90	0.03
5	110047	山鹰转债	159,892.70	0.03
6	110034	九州转债	159,268.00	0.03
7	128048	张行转债	158,572.70	0.03
8	132009	17 中油 EB	151,034.00	0.02
9	127006	敖东转债	148,547.60	0.02
10	113516	苏农转债	146,770.10	0.02
11	128034	江银转债	145,911.99	0.02
12	110038	济川转债	144,858.00	0.02
13	113505	杭电转债	144,244.80	0.02
14	113519	长久转债	137,418.60	0.02
15	113525	台华转债	134,190.00	0.02
16	110061	川投转债	36,520.40	0.01

5.11.5 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	504,612,980.14
本报告期基金总申购份额	260,698,737.42
减：本报告期基金总赎回份额	285,587,809.44
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	479,723,908.12

§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固有资金投资本基金。

§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

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	2021/1/1-2021/1/14	137,596,622.49	-	137,596,622.49	0.00	0.00%

产品特有风险

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：

- 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；
- 2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能

无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

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

4、其他可能的风险。

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

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富祥混合型证券投资基金的文件
- (二) 海富通富祥混合型证券投资基金基金合同
- (三) 海富通富祥混合型证券投资基金招募说明书
- (四) 海富通富祥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它文件

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