

海富通富泽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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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	海富通富泽混合
基金主代码	009156
交易代码	009156
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 6 月 22 日
报告期末基金份额总额	1,231,879,245.38 份
投资目标	本基金在严格控制下跌风险的前提下，通过量化选股和主动债券投资相结合的投资策略，力争实现战胜业绩比较基准的目标，追求资产净值的长期稳健增值。
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。本基金投资策略还包括债券投资组合策略、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。	
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。	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C
下属两级基金的交易代码	009156	009157
报告期末下属两级基金的份额总额	913,707,224.92 份	318,172,020.46 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)	
	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C
1.本期已实现收益	4,314,816.61	1,071,398.28
2.本期利润	8,835,940.43	5,023,509.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.0092	0.0133
4.期末基金资产净值	963,413,941.38	334,451,366.37
5.期末基金份额净值	1.0544	1.0512

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

1、海富通富泽混合 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	0.82%	0.37%	0.01%	0.30%	0.81%	0.07%
过去六个月	3.58%	0.28%	3.28%	0.25%	0.30%	0.03%
自基金合同生效起至今	5.44%	0.26%	3.75%	0.25%	1.69%	0.01%

2、海富通富泽混合 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	0.73%	0.37%	0.01%	0.30%	0.72%	0.07%
过去六个月	3.37%	0.28%	3.28%	0.25%	0.09%	0.03%
自基金合同生效起至今	5.12%	0.26%	3.75%	0.25%	1.37%	0.01%

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

海富通富泽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. 海富通富泽混合 A

(2020 年 6 月 22 日至 2021 年 3 月 31 日)



2. 海富通富泽混合 C

(2020 年 6 月 22 日至 2021 年 3 月 31 日)



注：1、本基金合同于 2020 年 6 月 22 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。

§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		
杜晓海	本基金的基金经理； 量化投资部总监。	2020-06-22	-	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 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

				<p>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。</p>	
张靖爽	本基金的基金经理；债券基金部副总监。	2020-06-22	-	11 年	<p>硕士，持有基金从业人员资格证书。历任中银基金管理有限公司研究员，交银施罗德基金管理有限公司投资经理、基金经理助理、研究员。2016 年 7 月至 2017 年 10 月任海富通双利债券基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 10 月兼任海富通一年定期开放债券基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 11 月兼任海富通纯债债券基金经理。2017 年 8 月起兼任海富通瑞福一年定开债券(现为海富通瑞福债券)和海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2018 年 2 月至 2021 年 2 月任海富通融丰定开债券基金经理。2018 年 11 月至 2020 年 10 月任海富通鼎丰定开债券基金经理。2019 年 5 月起兼任海富通新内需混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通聚合纯债基金经理。2019 年 12</p>

					月起兼任海富通裕通 30 个月定开债券基金经理。2020 年 4 月起兼任海富通裕昇三年定开债券基金经理。2020 年 5 月起兼任海富通瑞弘 6 个月定开债券基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。
--	--	--	--	--	--

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。同时，本基金积极参与新股申购，以增强投资收益。

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。同时，基金依然会积极参与新股申购，努力增厚收益。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 月中下旬成为资金面的分水岭，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，当看到杠杆增加和资产价格泡沫回升时，央行收紧了货币政策，反之则放松，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。

本组合一季度保持中性久期，并适时进行了利率债的波段操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通富泽混合 A 净值增长率为 0.82%，同期业绩比较基准收益率为 0.01%，基金净值跑赢业绩比较基准 0.81 个百分点；海富通富泽混合 C 净值增长率为 0.73%，同期业绩比较基准收益率为 0.01%，基金净值跑赢业绩比较基准 0.72 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	277,627,789.33	20.78
	其中：股票	277,627,789.33	20.78
2	固定收益投资	983,008,255.23	73.59
	其中：债券	972,966,255.23	72.84
	资产支持证券	10,042,000.00	0.75

3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	5,000,000.00	0.37
	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	35,415,538.03	2.65
7	其他资产	34,706,167.80	2.60
8	合计	1,335,757,750.39	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	-	-
B	采矿业	5,924,029.20	0.46
C	制造业	185,905,414.46	14.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,779,992.12	1.06
E	建筑业	634,766.00	0.05
F	批发和零售业	3,302,974.82	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	424,380.00	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,440,987.15	0.42
J	金融业	37,357,648.00	2.88
K	房地产业	7,068,310.30	0.54
L	租赁和商务服务业	1,771,350.00	0.14
M	科学研究和技术服务业	850,392.00	0.07
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	-	-
Q	卫生和社会工作	1,378,385.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	227,521.00	0.02

S	综合	-	-
	合计	264,089,089.25	20.35

5.2.2 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	6,749,446.89	0.52
金融	4,804,728.29	0.37
工业	763,806.07	0.06
通讯服务	430,619.21	0.03
能源	419,150.12	0.03
原材料	370,949.50	0.03
合计	13,538,700.08	1.04

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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	6,100	12,254,900.00	0.94
2	600036	招商银行	195,600	9,995,160.00	0.77
3	601318	中国平安	113,700	8,948,190.00	0.69
4	000333	美的集团	99,500	8,181,885.00	0.63
5	000538	云南白药	68,700	8,094,997.00	0.62
6	600031	三一重工	215,200	7,349,080.00	0.57
7	601966	玲珑轮胎	155,155	7,261,254.00	0.56
8	000661	长春高新	14,900	6,616,827.00	0.51
9	00700	腾讯控股	12,700	6,547,609.46	0.50
10	601166	兴业银行	262,500	6,323,625.00	0.49

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	122,031,200.00	9.40
2	央行票据	-	-
3	金融债券	216,964,000.00	16.72

	其中：政策性金融债	176,730,000.00	13.62
4	企业债券	207,906,000.00	16.02
5	企业短期融资券	10,037,000.00	0.77
6	中期票据	183,327,000.00	14.13
7	可转债（可交换债）	17,378,055.23	1.34
8	同业存单	215,323,000.00	16.59
9	其他	-	-
10	合计	972,966,255.23	74.97

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	200313	20 进出 13	1,700,000	170,697,000.00	13.15
2	112017275	20 光大银行 CD275	1,000,000	97,790,000.00	7.53
3	019640	20 国债 10	720,000	71,971,200.00	5.55
4	200014	20 付息国债 14	500,000	50,060,000.00	3.86
5	112072063	20 郑州银行 CD247	500,000	49,250,000.00	3.79

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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	2089344	20 招银和智 2 优先 A1	100,000	10,042,000.00	0.77

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

代码	名称	持仓量	合约市值 (元)	公允价值变 动(元)	风险说明
IF2106	IF2106	-10.00	-14,820,000.0 0	1,822,028.57	-
公允价值变动总额合计(元)					1,822,028.5 7
股指期货投资本期收益(元)					-2,185,188.5 7
股指期货投资本期公允价值变动(元)					4,019,708.5 7

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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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20北京银行CD127（112012127）的发行人，因在债务融资工具注册发行和后续管理期间尽职调查工作未遵循勤勉尽责原则、未保证调查质量，未对康得新参与现金管理业务的情况进行充分尽职调查并督导披露。未监测到康得新将募

集资金划出体外的情况并督导披露募集资金用途变更信息，被中国银行间市场交易协会处以警告处分并暂停债务融资工具主承销相关业务6个月。发行人因同业投资对资产转让业务承担回购义务，同业投资资产风险分类调整不及时、延缓风险暴露，收费管理政策执行不严、违规收取相关费用，个人贷款自主支付管理薄弱、贷款资金违规流入股市、房市，于2020年7月11日被北京银保监局责令改正，并给予合计150万元罚款、对相关责任人给予警告的行政处罚。发行人因现金管理业务内部控制存在缺陷，以及某支行出具与事实不符的询证函回函和存款证明、内部控制存在缺陷，于2020年12月23日被北京银保监局责令改正，并给予合计350万元罚款的行政处罚；并对相关责任人处以取消5年董事、高级管理人员任职资格、或相应金额罚款的行政处罚。发行人因对外销售虚假金融产品、出具与事实不符的单位定期存款开户证实书、关键业务环节管理失控、同城清算业务凭证要件信息不真实、印章管理混乱等违规行为，于2020年12月30日被北京银保监局责令改正，并给予合计3940万元罚款的行政处罚；对相关责任人分别给予禁止一定期限从事银行业工作、取消一定期限董事/高级管理人员任职资格、或相应金额罚款的行政处罚。

对该证券的投资决策程序的说明：银行业整体信用水平高，且该银行为地区中大型银行，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郑州银行CD247（112072063）的发行人因虚报、瞒报金融统计资料、超过期限或未向中国人民银行报送账户开立、变更、撤销等资料、未按规定履行客户身份识别义务、未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、未按规定设置“待结算财政款项”一级科目等违规行为，于2021年1月18日被中国人民银行郑州中心支行警告并处罚款146.1万元。

对该证券的投资决策程序的说明：银行业整体信用水平高，且该银行为地区中型银行，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光大银行CD275（112017275）的发行人，作为债务融资工具主承销商，因在为永城煤电控股集团有限公司（以下简称“永煤控股”）提供中介服务过程中，存在如下违反银行间债券市场相关自律管理规则的行为：未对永煤控股独立性开展进一步核查并在尽职调查报告中体现，未能充分保证尽职调查质量；永煤控股DFI项目尽职调查工作开展不规范。根据银行间债券市场相关自律规定，中国银行间市场交易商协会于2021年1月15日对光大银行予以诫勉谈话，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。同时，中国银行间市场交易商协会已将光大银行有关违规情况报送中国人民银行、中国银保监会。

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。

其余七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	1,864,273.94
2	应收证券清算款	15,863,314.45
3	应收股利	-
4	应收利息	16,769,831.89
5	应收申购款	208,747.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,706,167.80

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	127012	招路转债	1,390,870.00	0.11
2	110064	建工转债	1,065,790.00	0.08
3	110048	福能转债	970,080.00	0.07
4	110033	国贸转债	964,980.00	0.07
5	128083	新北转债	706,720.00	0.05
6	110068	龙净转债	640,573.60	0.05
7	113532	海环转债	597,420.00	0.05
8	113525	台华转债	546,700.00	0.04
9	113564	天目转债	543,080.00	0.04
10	113505	杭电转债	533,906.10	0.04

11	110074	精达转债	524,900.00	0.04
12	113024	核建转债	510,090.00	0.04
13	128081	海亮转债	508,750.00	0.04
14	128132	交建转债	486,000.00	0.04
15	113508	新风转债	480,440.00	0.04
16	113017	吉视转债	470,000.00	0.04
17	127013	创维转债	432,000.00	0.03
18	113014	林洋转债	374,860.20	0.03
19	127016	鲁泰转债	354,457.46	0.03
20	113026	核能转债	317,940.00	0.02
21	128071	合兴转债	313,020.00	0.02
22	110038	济川转债	310,410.00	0.02
23	123059	银信转债	302,370.00	0.02
24	113039	嘉泽转债	258,700.00	0.02
25	128044	岭南转债	222,700.00	0.02
26	123049	维尔转债	222,440.00	0.02
27	128125	华阳转债	217,914.80	0.02
28	113563	柳药转债	217,800.00	0.02
29	113030	东风转债	204,080.00	0.02
30	110052	贵广转债	195,080.00	0.02
31	128124	科华转债	192,800.00	0.01
32	127019	国城转债	167,780.00	0.01
33	110043	无锡转债	122,770.00	0.01
34	113559	永创转债	119,950.00	0.01
35	110051	中天转债	119,620.00	0.01
36	113034	滨化转债	118,270.00	0.01
37	110034	九州转债	109,840.00	0.01
38	127020	中金转债	108,390.00	0.01
39	110041	蒙电转债	106,710.00	0.01
40	113021	中信转债	105,270.00	0.01
41	128101	联创转债	102,860.00	0.01

42	113599	嘉友转债	102,690.00	0.01
43	128018	时达转债	101,940.00	0.01
44	113530	大丰转债	99,000.00	0.01
45	128037	岩土转债	98,340.00	0.01
46	113519	长久转债	97,460.00	0.01
47	128127	文科转债	96,840.00	0.01
48	113596	城地转债	86,630.00	0.01
49	128087	孚日转债	23,187.50	0.00

5.11.5 报告期末前十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	000538	云南白药	4,997,890.00	0.39	大宗交易
2	000661	长春高新	2,134,800.00	0.16	大宗交易

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通富泽混合A	海富通富泽混合C
本报告期期初基金份额总额	1,022,189,480.03	466,852,418.21
本报告期基金总申购份额	148,259,167.92	74,755,128.18
减：本报告期基金总赎回份额	256,741,423.03	223,435,525.93
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	913,707,224.92	318,172,020.46

§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

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

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