

**海富通稳固收益债券型证券投资基金**  
**2021 年第 2 季度报告**  
**2021 年 6 月 30 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：二〇二一年七月二十一日

## §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 7 月 20 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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	海富通稳固收益债券
基金主代码	519030
交易代码	519030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 11 月 23 日
报告期末基金份额总额	569,116,615.09 份
投资目标	通过合理运用投资组合优化策略，力争实现基金收益随着时间增长的逐步提升。
投资策略	本基金的整体投资策略分为三个层次：第一层次，即资产配置策略，将以优化投资组合保险策略为核心，实现基金投资目标；第二层次，即债券投资策略，将采用自上而下的策略，以久期管理为核心；第三层次，即股票投资策略，包括新股申购策略和积极的精选个股策略。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于中低风险品种。其预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	13,502,990.45
2.本期利润	12,845,135.95
3.加权平均基金份额本期利润	0.0222
4.期末基金资产净值	722,375,635.29
5.期末基金份额净值	1.269

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	1.76%	0.19%	0.68%	0.01%	1.08%	0.18%
过去六个月	2.84%	0.27%	1.35%	0.01%	1.49%	0.26%
过去一年	9.11%	0.33%	2.75%	0.01%	6.36%	0.32%
过去三年	25.22%	0.26%	8.49%	0.01%	16.73%	0.25%
过去五年	24.06%	0.26%	14.54%	0.01%	9.52%	0.25%
自基金合同生效起至今	87.83%	0.52%	43.50%	0.01%	44.33%	0.51%

##### 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

海富通稳固收益债券型证券投资基金  
 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  
 (2010 年 11 月 23 日至 2021 年 6 月 30 日)



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。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十一部分（二）投资范围、（五）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		
陈轶平	本基金的基金经理；固定收益投资	2015-12-18	-	12 年	博士，CFA。持有基金从业人员资格证书。历任 Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师、瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益交易组合研究支持部副

	副总监兼债券基金部总监。			<p>董事,2011 年 10 月加入海富通基金管理有限公司,历任债券投资经理、基金经理、现金管理部副总监、债券基金部总监,现任固定收益投资副总监兼债券基金部总监。2013 年 8 月至 2020 年 7 月任海富通货币基金经理。2014 年 8 月至 2019 年 9 月兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2014 年 11 月起兼任海富通上证可质押城投债 ETF (现为海富通上证城投债 ETF) 基金经理。2015 年 12 月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015 年 12 月至 2017 年 9 月兼任海富通稳进增利债券 (LOF) 基金经理。2016 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通一年定开债券基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2016 年 8 月至 2019 年 10 月兼任海富通瑞丰一年定开债券 (现为海富通瑞丰债券) 基金经理。2016 年 8 月至 2017 年 11 月兼任海富通瑞益债券基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 10 月兼任海富通美元债 (QDII) 基金经理。2017 年 1 月至 2021 年 3 月兼任海富通上证周期产业债 ETF 基金经理。2017 年 2 月起兼任海富通瑞利债券基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 6 月兼任海富通富源债券基金</p>
--	--------------	--	--	---

					<p>经理。2017 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通瑞合纯债基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 9 月兼任海富通富睿混合（现海富通沪深 300 指数增强）基金经理。2017 年 7 月至 2019 年 9 月兼任海富通瑞福一年定开债券（现为海富通瑞福债券）、海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2017 年 7 月至 2018 年 12 月兼任海富通欣悦混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通恒丰定开债券基金经理。2018 年 10 月起兼任海富通上证 10 年期地方政府债 ETF 基金经理。2018 年 11 月起兼任海富通弘丰定开债券基金经理。2019 年 1 月起兼任海富通上清所短融债券基金经理。2019 年 11 月起兼任海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 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 7 月起兼任海富通上证投资级可转债 ETF 基金经理。</p>
江勇	本基金的基金经理	2020-10-29	-	10 年	<p>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</p>

					<p>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。2021 年 6 月起兼任海富通中证港股通科技 ETF 和海富通策略收益债券基金经理。</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 年二季度，全球市场在新冠疫情后整体走牛，由于疫苗接种以及大规模的财政刺激，二季度美国经济持续恢复，随着美债收益率震荡走弱，市场流动性预期转向宽松。国内消费仍未完全恢复到疫情前的水平，出口也面临不确定性，就业压力仍大，二季度货币政策继续维持“稳健中性”的操作风格，市场流动性也保持“量平价稳”的特征。

在流动性泛滥、各大经济体逐步复工复产的背景下，二季度全球权益市场均表现出较强走势。具体来看，2021 年二季度沪深 300 指数、科创 50 指数、中小 100 指数、创业板指等主要指数涨幅分别达到 3.48%、27.23%、11.29%、26.05%。就行业表现而言，28 个申万一级行业表现分化显著。二季度涨幅居前五位的行业分别是电气设备、电子、汽车、综合、化工，涨幅分别为 30.70%、21.22%、18.99%、17.54% 和 16.78%。与之相比，家用电器、农林牧渔、房地产、公共事业、建筑材料表现最差，其中家用电器跌幅最惨为-8.51%。

从二季度 A 股内部的结构看，业绩高确定和较高增长的资产获得了市场的追捧。二季度行情主要集中在医药和科技两个方向，包括医美、CXO 为代表的医药板块，以及新能源车、光伏和半导体、物联网等中国经济转型升级的科技板块。而传统经济领域的家电、房地产、非银和银行等防御性的板块持续表现低迷。

报告期间，本基金权益仓位保持稳定，行业分布较为均衡，具体个股根据盈利与估值的匹配度有所调整。

债券方面，回顾二季度，经济基本面总体表现为修复速度有所放缓，债券收益率震荡下行，收益率曲线先陡后平。两会召开后，从 3 月底至 5 月底，债市开启收益率震荡下行阶段，10 年期国债收益率从 3.27% 逐步下行突破 3.10%，并一度下探至 3.04%。其主要原因是市场对经济增长、通胀压力、货币政策保持平稳等因素具有一致预期，市场对利空反应钝化。国内经济恢复整体稳健，但结构上有所分化，具体的韧性体现在制造业投资、地产与出口，但基建投资与消费的修复较弱。通胀方面，受到基数原因与上游原材料价格例如铜、原油以及黑色系价格大幅飙升影响，工业品通胀压力凸显，但债市反应平淡，市场或理解为通胀不具有长期上涨的趋势。货币政策方面保持稳健，叠加地方政府专项债的发行进度不及预期，流动性平稳宽松，为债市收益率下行提供环境。但 6 月初至 6 月底，债市进入收益率震荡反弹的阶段，10 年期国债收益率从 3.05% 低位逐步回升至 3.10% 以上。主要原因是经济虽然增速高点已过，但通胀压力加大，地方债发行明显提速，收益率向上和向下皆有阻力，债市表现为窄幅震荡的格局。整季来看，10 年期国债收益率累计下行 11.1bp。

信用债方面，二季度由于期间有发行材料补年报的影响，信用债净融资经历了先降后升，但由于地产、城投各自面临“红橙黄绿”分档监管，信用债的供给增速逐渐收敛。而随着信用债整体的到期高峰期平稳度过，市场情绪有所好转，叠加小型资产荒，二季度信用债收益率整体下行，中低等级下行幅度大于高等级。

可转债方面，二季度中证转债指数上涨 4.45%，同期沪深 300、上证指数、创业板上涨 3.48%、4.34%、26.05%。二季度成长股迎来爆发，转债中的科技成长标的表现出色，尤其是新能源车、芯片、光伏相关个券获得较大涨幅。

本管理人在二季度根据组合规模情况配置中高等级信用债并调整利率债久期，积极参与波段机会。同时，本管理人二季度根据市场情况调整可转债资产，以在控制波动的同时获取权益上涨收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 1.76%，同期业绩比较基准收益率为 0.68%。

#### 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	127,147,086.01	13.78
	其中：股票	127,147,086.01	13.78
2	固定收益投资	772,529,740.68	83.74
	其中：债券	772,529,740.68	83.74
	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	10,459,551.61	1.13
7	其他资产	12,369,918.16	1.34

8	合计	922,506,296.46	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	6,182,333.22	0.86
C	制造业	78,226,853.61	10.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,976,392.00	0.41
E	建筑业	1,991,584.00	0.28
F	批发和零售业	1,514,528.00	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	1,035,582.00	0.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,822,581.40	0.53
J	金融业	22,294,948.40	3.09
K	房地产业	4,209,944.00	0.58
L	租赁和商务服务业	2,239,030.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	722,782.38	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	710,181.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	127,816.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	1,092,530.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	127,147,086.01	17.60

### 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	600036	招商银行	103,300	5,597,827.00	0.77
2	000001	平安银行	153,600	3,474,432.00	0.48
3	600519	贵州茅台	1,500	3,085,050.00	0.43
4	600887	伊利股份	80,900	2,979,547.00	0.41
5	601318	中国平安	34,900	2,243,372.00	0.31
6	600031	三一重工	72,500	2,107,575.00	0.29
7	300059	东方财富	59,760	1,959,530.40	0.27
8	601009	南京银行	182,400	1,918,848.00	0.27
9	002415	海康威视	29,269	1,887,850.50	0.26
10	600741	华域汽车	69,300	1,820,511.00	0.25

## 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	80,190,000.00	11.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	353,146,629.00	48.89
	其中：政策性金融债	141,877,629.00	19.64
4	企业债券	130,470,000.00	18.06
5	企业短期融资券	35,059,000.00	4.85
6	中期票据	141,657,000.00	19.61
7	可转债（可交换债）	32,007,111.68	4.43
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	772,529,740.68	106.94

## 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	018009	国开 1803	731,300	81,415,629.00	11.27

2	019640	20 国债 10	801,900	80,190,000.00	11.10
3	2120025	21 杭州银行小微债 01	500,000	50,385,000.00	6.97
4	2128013	21 交通银行小微债	500,000	50,310,000.00	6.96
5	210205	21 国开 05	300,000	30,375,000.00	4.20

## 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

根据本基金合同，本基金暂未参与股指期货交易。

## 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国开1803(018009)、21国开05(210205)、21国开03(210203)

的发行人，因为违规的政府购买服务项目提供融资、项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况、违规变相发放土地储备贷款、设置不合理存款考核要求，以贷转存，虚增存款、贷款风险分类不准确等违规行为，于2020年12月25日被中国银行保险监督管理委员会处罚罚款4880万元。

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政策性银行，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21招商银行小微债01（2128004）的发行人，因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品、理财产品之间风险隔离不到位等多项违规行为，于2021年05月17日被中国银行保险监督管理委员会处以罚款7170万元。

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21广发03（149499）的发行人，因在康美药业股份有限公司2014年非公开发行优先股项目、2015年公司债券项目、2016年非公开发行股票项目、2018年公司债券项目、康美实业投资控股有限公司2017年可交换公司债券项目中未勤勉尽责，尽职调查环节基本程序缺失，缺乏应有的执业审慎，内部质量控制流于形式，未按规定履行持续督导与受托管理义务，于2020年07月20日被中国证券监督管理委员会广东监管局采取责令改正、暂停2020年7月20日至 2021年1月19日期间公司保荐机构资格、暂不受理2020年7月20日至 2021年7月19日期间公司债券承销业务、责令限制相应高级管理人员权利的监管措施，并将相关责任人认定为不适当人选等措施。

对该证券的投资决策程序的说明：该券商为全国大型综合券商，全国排名前列，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。

其余五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	55,132.92
2	应收证券清算款	1,405,152.35
3	应收股利	-

4	应收利息	10,732,741.81
5	应收申购款	176,891.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,369,918.16

#### 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	128095	恩捷转债	418,319.20	0.06
2	110051	中天转债	414,536.30	0.06
3	128128	齐翔转 2	305,409.10	0.04
4	128113	比音转债	302,579.20	0.04
5	113611	福 20 转债	289,111.20	0.04
6	113034	滨化转债	286,881.20	0.04
7	123058	欣旺转债	274,049.00	0.04
8	113615	金诚转债	273,468.80	0.04
9	123012	万顺转债	268,415.40	0.04
10	113582	火炬转债	267,914.00	0.04
11	113527	维格转债	265,905.70	0.04
12	123070	鹏辉转债	261,420.30	0.04
13	123033	金力转债	250,502.40	0.03
14	113025	明泰转债	249,281.90	0.03
15	128046	利尔转债	247,467.84	0.03
16	110066	盛屯转债	245,464.20	0.03
17	113508	新风转债	245,340.90	0.03
18	127011	中鼎转 2	241,287.50	0.03
19	113599	嘉友转债	240,508.80	0.03
20	113550	常汽转债	240,492.60	0.03
21	110048	福能转债	240,444.00	0.03
22	113585	寿仙转债	239,836.00	0.03

23	128105	长集转债	239,431.40	0.03
24	123025	精测转债	238,949.10	0.03
25	113545	金能转债	237,462.10	0.03
26	113040	星宇转债	236,588.90	0.03
27	123063	大禹转债	235,418.40	0.03
28	128134	鸿路转债	234,952.20	0.03
29	110061	川投转债	233,162.20	0.03
30	128017	金禾转债	232,880.06	0.03
31	113009	广汽转债	232,712.40	0.03
32	123048	应急转债	230,969.10	0.03
33	113013	国君转债	230,132.40	0.03
34	113602	景 20 转债	229,226.10	0.03
35	128136	立讯转债	229,222.00	0.03
36	113534	鼎胜转债	228,889.20	0.03
37	123044	红相转债	228,180.60	0.03
38	113588	润达转债	227,563.50	0.03
39	128137	洁美转债	227,466.20	0.03
40	110073	国投转债	227,268.10	0.03
41	128048	张行转债	226,981.60	0.03
42	110047	山鹰转债	226,339.80	0.03
43	113026	核能转债	225,204.90	0.03
44	123056	雪榕转债	224,464.80	0.03
45	128139	祥鑫转债	224,246.40	0.03
46	110034	九州转债	222,974.40	0.03
47	113584	家悦转债	222,632.60	0.03
48	110076	华海转债	222,522.30	0.03
49	123035	利德转债	222,518.31	0.03
50	123091	长海转债	221,544.00	0.03
51	128035	大族转债	220,094.00	0.03
52	127015	希望转债	219,856.80	0.03
53	128114	正邦转债	218,757.60	0.03

54	128135	洽洽转债	218,122.00	0.03
55	127017	万青转债	217,426.32	0.03
56	128096	奥瑞转债	215,794.50	0.03
57	128119	龙大转债	215,339.30	0.03
58	113603	东缆转债	214,395.20	0.03
59	127022	恒逸转债	213,672.00	0.03
60	113605	大参转债	212,593.60	0.03
61	127025	冀东转债	212,442.42	0.03
62	128141	旺能转债	212,377.20	0.03
63	127024	盈峰转债	210,119.10	0.03
64	113543	欧派转债	207,390.50	0.03
65	128029	太阳转债	183,523.30	0.03
66	110074	精达转债	181,671.00	0.03
67	123007	道氏转债	180,609.00	0.03
68	128111	中矿转债	169,690.60	0.02
69	123067	斯莱转债	162,607.50	0.02
70	128097	奥佳转债	159,345.03	0.02
71	128026	众兴转债	158,966.40	0.02
72	128032	双环转债	151,087.72	0.02
73	113537	文灿转债	144,419.90	0.02
74	110055	伊力转债	142,272.40	0.02
75	113548	石英转债	141,933.00	0.02
76	113525	台华转债	141,158.40	0.02
77	128093	百川转债	139,838.40	0.02
78	132014	18 中化 EB	129,966.60	0.02
79	128033	迪龙转债	129,470.00	0.02
80	123022	长信转债	127,073.60	0.02
81	128051	光华转债	126,007.60	0.02
82	113039	嘉泽转债	125,961.00	0.02
83	123057	美联转债	125,958.60	0.02
84	128037	岩土转债	125,693.10	0.02

85	113568	新春转债	125,268.00	0.02
86	128076	金轮转债	123,797.70	0.02
87	113014	林洋转债	123,576.00	0.02
88	128064	司尔转债	122,343.24	0.02
89	127014	北方转债	121,927.40	0.02
90	128069	华森转债	121,417.00	0.02
91	113504	艾华转债	120,820.70	0.02
92	110045	海澜转债	120,560.40	0.02
93	128073	哈尔转债	120,344.00	0.02
94	110053	苏银转债	120,146.40	0.02
95	110033	国贸转债	120,078.40	0.02
96	113541	荣晟转债	119,892.00	0.02
97	128066	亚泰转债	119,828.00	0.02
98	123065	宝莱转债	119,802.30	0.02
99	128081	海亮转债	119,395.50	0.02
100	128133	奇正转债	119,075.85	0.02
101	113549	白电转债	119,034.20	0.02
102	110071	湖盐转债	118,903.20	0.02
103	113589	天创转债	118,700.00	0.02
104	128116	瑞达转债	118,521.00	0.02
105	128087	孚日转债	118,001.50	0.02
106	113030	东风转债	117,999.60	0.02
107	128109	楚江转债	117,975.48	0.02
108	127018	本钢转债	117,894.24	0.02
109	127013	创维转债	117,880.00	0.02
110	113505	杭电转债	117,813.80	0.02
111	128124	科华转债	117,712.00	0.02
112	113601	塞力转债	117,705.20	0.02
113	113524	奇精转债	117,644.30	0.02
114	128023	亚太转债	117,560.10	0.02
115	113578	全筑转债	117,055.60	0.02

116	128057	博彦转债	117,002.00	0.02
117	123023	迪森转债	116,958.90	0.02
118	113519	长久转债	116,804.40	0.02
119	128117	道恩转债	116,564.00	0.02
120	128090	汽模转 2	116,430.40	0.02
121	110052	贵广转债	116,391.50	0.02
122	128039	三力转债	116,391.00	0.02
123	128072	翔鹭转债	116,324.80	0.02
124	110057	现代转债	116,282.40	0.02
125	113535	大业转债	116,150.00	0.02
126	128083	新北转债	115,796.80	0.02
127	128044	岭南转债	115,724.40	0.02
128	113600	新星转债	115,701.30	0.02
129	132021	19 中电 EB	115,592.40	0.02
130	113569	科达转债	115,430.00	0.02
131	113017	吉视转债	115,191.60	0.02
132	128014	永东转债	115,148.00	0.02
133	128132	交建转债	115,139.97	0.02
134	113565	宏辉转债	115,003.60	0.02
135	123049	维尔转债	114,978.76	0.02
136	128053	尚荣转债	114,930.00	0.02
137	127006	敖东转债	114,661.10	0.02
138	123004	铁汉转债	114,531.20	0.02
139	113037	紫银转债	114,518.70	0.02
140	110063	鹰 19 转债	114,450.30	0.02
141	110038	济川转债	114,417.30	0.02
142	113033	利群转债	114,228.00	0.02
143	113012	骆驼转债	114,132.20	0.02
144	132018	G 三峡 EB1	114,114.00	0.02
145	110056	亨通转债	114,074.70	0.02
146	127019	国城转债	113,900.00	0.02

147	128127	文科转债	113,842.40	0.02
148	110068	龙净转债	113,723.20	0.02
149	127005	长证转债	113,625.80	0.02
150	132004	15 国盛 EB	113,553.00	0.02
151	110064	建工转债	113,528.00	0.02
152	132015	18 中油 EB	113,497.50	0.02
153	127012	招路转债	113,451.80	0.02
154	113532	海环转债	113,226.00	0.02
155	132009	17 中油 EB	113,190.00	0.02
156	113596	城地转债	113,112.80	0.02
157	113021	中信转债	112,959.90	0.02
158	110062	烽火转债	112,805.20	0.02
159	110067	华安转债	112,791.00	0.02
160	110041	蒙电转债	112,735.20	0.02
161	113024	核建转债	112,717.00	0.02
162	110059	浦发转债	112,673.00	0.02
163	128075	远东转债	112,450.24	0.02
164	110070	凌钢转债	112,199.90	0.02
165	128130	景兴转债	111,959.10	0.02
166	128108	蓝帆转债	111,832.50	0.02
167	127020	中金转债	111,674.60	0.02
168	128129	青农转债	111,134.40	0.02
169	128107	交科转债	110,839.76	0.02
170	113011	光大转债	109,801.00	0.02
171	132017	19 新钢 EB	109,791.00	0.02
172	128050	钧达转债	109,522.50	0.02
173	110060	天路转债	109,463.80	0.02
174	110075	南航转债	109,372.10	0.02
175	113577	春秋转债	109,354.30	0.02
176	128106	华统转债	109,240.60	0.02
177	128036	金农转债	108,408.30	0.02

178	113563	柳药转债	108,302.30	0.01
179	110043	无锡转债	108,172.80	0.01
180	113595	花王转债	107,162.50	0.01
181	113598	法兰转债	99,258.80	0.01
182	128034	江银转债	67,012.40	0.01
183	123071	天能转债	465.24	0.00
184	128078	太极转债	230.60	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

本基金本报告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	596,076,378.75
本报告期基金总申购份额	46,731,907.05
减：本报告期基金总赎回份额	73,691,670.71
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	569,116,615.09

## §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	2021/4/1-2021/6/30	120,000,000.00	-	-	120,000,000.00	21.09%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；</p> <p>2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。</p> <p>3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于5000万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> <p>4、其他可能的风险。</p> <p>另外，当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。</p>							

## 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 99 只公募基金。截至 2021 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1296 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稳固收益债券型证券投资基金的文件
- （二）海富通稳固收益债券型证券投资基金基金合同
- （三）海富通稳固收益债券型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通稳固收益债券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  
二〇二一年七月二十一日