

**海富通稳固收益债券型证券投资基金**  
**2021 年第 4 季度报告**  
**2021 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年一月二十二日

## §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 2022 年 1 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 10 月 1 日起至 12 月 31 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	3,166,302,227.04 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 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	29,074,246.91
2.本期利润	68,622,984.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.0378
4.期末基金资产净值	3,868,964,603.58
5.期末基金份额净值	1.2219

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	2.89%	0.18%	0.69%	0.01%	2.20%	0.17%
过去六个月	5.54%	0.26%	1.38%	0.01%	4.16%	0.25%
过去一年	8.53%	0.26%	2.75%	0.01%	5.78%	0.25%
过去三年	29.62%	0.27%	8.49%	0.01%	21.13%	0.26%
过去五年	30.30%	0.24%	14.54%	0.01%	15.76%	0.23%
自基金合同生效起至今	98.24%	0.51%	45.47%	0.01%	52.77%	0.50%

##### 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 12 月 31 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		
江勇	本基金的基金经理	2020-10-29	-	10 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。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。2021 年 9 月起兼任海富通欣利混合基金经理。	
陈轶平	本基金的基金经理；固定收益投资总监兼债券基金部总监。	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、现金管理部副总监、债券基金部总监，现任固定收益投资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

				<p>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</p>
--	--	--	--	--

					<p>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。2021 年 7 月起兼任海富通利率债债券基金经理。</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：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间交易的样本，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

权益部分，2021 年四季度，国内经济延续下行趋势，其中房地产投资、销售、新开工全线下滑，基建投资与消费继续疲软，出口及制造业投资链条仍是少数亮点。价格指数方面，CPI 走势相对温和，PPI 在创出历史新高后开始回落。在需求下滑及政策“保供顺价”背景下，能源领域的供需错配暂时告一段落。海外经济方面，美国商品消费向服务消费切换的速度慢于预期。商品消费仍然高于趋势水平，服务需求仍低于趋势水平。货币政策方面，美联储加速缩减购债规模，同时加息预期开始升温。

四季度国内权益市场延续上行，科技成长板块表现较好，消费板块延续分化，周期板块显著调整。A 股主要指数方面，上证指数上涨 2.01%，沪深 300 上涨 1.52%，中证 800 上涨 2.01%，中小 100 指上涨 6.21%，创业板指上涨 2.40%，中证 500 上涨 3.60%。以中信行业分类看，成长板块显著上涨，四季度涨幅前五的行业为传媒、国防军工、通信、综合金融、轻工制造，分别上涨 22.72%、17.48%、14.59%、12.58% 和 12.21%，其中大部分为成长性板块；周期板块显著回调，跌幅前五的行业为煤炭、石油石化、钢铁、消费者服务、银行，分别下跌 12.61%、9.51%、7.17%、6.4% 和 0.94%。从四季度 A 股内部结构看，成长板块表现较好，与流动性充裕下的中小盘风格发散有关；消费板块表现分化，一方面与国内消费数据疲弱相符，另一方面则与部分消费品提价有关；而周期板块大幅调整，则与政策“保供顺价”密切相关。

市场结构方面，四季度市场结构延续了前三季度情况，在资金存量博弈行情下，行业、风格轮动较快，周期、成长交相成为市场主线，消费阶段性有所表现。业绩增速高且确定性强的新能源汽车产业链引领整个成长板块。消费领域受部分产品提价及提价预期影响有所表现。在板块裂口短期过大情况下，风格分化在四季度陆续有所收敛，部分消费品和“核心资产”触底反弹，而周期和成长则开始回调。

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。

固定收益方面，四季度国内经济有所走弱，债券收益率呈现震荡小幅下行。具体而言，10 月以来限电、能耗双控等不利因素消退，国内生产有所反弹，PMI 指标重新回到 50% 以上。但投资方面受到“贷款双集中”、“三道红线”监管、集中供地等政策的影响，同时以恒大为代表的风险事件在地产行业发酵蔓延，地产投资增速大幅回落，单月同比增速转负；同时基建投资增速在缺乏项目与年内缺乏托底经济的动力的情况下维持低位；



制造业投资在中游出口需求较好、高技术产业投资旺盛的带动下表现强势。四季度消费在国内疫情局部反复的情况下表现较为疲软，尤其是线下消费与餐饮相关的行业受损严重。出口受到海外经济复苏的支撑维持较好的韧性，其中机电产品出口表现亮眼。通胀方面，四季度 CPI 在猪肉价格企稳、蔬菜价格受极端天气影响的背景下有所上行，PPI 在煤炭保供限价的政策组合下见顶回落。在这种经济环境下，四季度货币政策继续维持宽松，12 月央行年度第 2 次降准 50bp，释放中长期资金约 1.2 万亿，此外还陆续推出碳减排支持工具、下调支农支小再贷款利率等结构性政策。对应债市而言，10 月宽货币落空而宽信用预期升温，债券到期收益率上行，最高达到 3.04% 的水平。11 月新冠变异毒株欧米克戎对资本市场的影响开始发酵，债券到期收益率震荡下行。12 月随着经济基本面走弱被进一步确认，在降准的带动下降息预期逐渐升温，10 年期国债到期收益率年底下行至 2.79% 的水平。整个四季度 10 年期国债收益率下行 10.2BP。信用债方面，四季度信用债收益率总体波动下行。当前信用债收益率整体处于历史 1/5 分位数以下，信用利差继续分化。城投方面，广东、上海于 10 月先后宣布启动全域无隐性债务试点，同时，土地市场热度下降，引发市场对地方财政收入下滑、可协调资源减少以及城投偿债能力弱化的担忧，城投偿债政策整体呈现“管两头”的特征；地产方面，下半年房地产融资、拿地、销售受到全面管控，信用风险事件和异常成交频发，行业利差大幅攀升，虽 11 月以来针对地产的政策导向缓和，但改善的背后行业内部分化加剧。

可转债方面，4 季度中证转债指数上涨 7.0%，转债表现依旧亮眼。转债受到市场资金热捧，整体估值水平也处于历史高位。

本组合在四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，本组合四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 2.89%，同期业绩比较基准收益率为 0.69%，基金净值跑赢业绩比较基准 2.20 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	559,569,448.03	13.23
	其中：股票	559,569,448.03	13.23
2	固定收益投资	3,282,170,171.55	77.57
	其中：债券	3,282,170,171.55	77.57
	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	273,440,692.41	6.46
7	其他资产	115,783,584.87	2.74
8	合计	4,230,963,896.86	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	771,324.00	0.02
B	采矿业	20,531,500.40	0.53
C	制造业	359,148,370.08	9.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,789,184.00	0.43
E	建筑业	15,626,689.00	0.40
F	批发和零售业	8,778,475.00	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	7,162,068.00	0.19
H	住宿和餐饮业	412,854.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,307,613.60	0.40
J	金融业	79,952,615.95	2.07
K	房地产业	21,882,955.00	0.57

L	租赁和商务服务业	2,473,073.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	4,164,836.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	4,337,936.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,314,166.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	915,788.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	559,569,448.03	14.46

### 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	002142	宁波银行	335,890	12,857,869.20	0.33
2	300059	东方财富	327,825	12,165,585.75	0.31
3	600036	招商银行	221,000	10,764,910.00	0.28
4	600887	伊利股份	238,600	9,892,356.00	0.26
5	600519	贵州茅台	4,000	8,200,000.00	0.21
6	000776	广发证券	267,000	6,565,530.00	0.17
7	000858	五粮液	27,200	6,056,352.00	0.16
8	601688	华泰证券	339,300	6,025,968.00	0.16
9	600690	海尔智家	199,400	5,960,066.00	0.15
10	600741	华域汽车	197,000	5,575,100.00	0.14

### 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	191,143,255.30	4.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,002,831,780.30	51.77
	其中：政策性金融债	1,447,881,780.30	37.42
4	企业债券	241,218,000.00	6.23

5	企业短期融资券	290,396,000.00	7.51
6	中期票据	172,217,000.00	4.45
7	可转债（可交换债）	384,364,135.95	9.93
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,282,170,171.55	84.83

### 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	210203	21 国开 03	5,800,000	592,238,000.00	15.31
2	210208	21 国开 08	3,800,000	381,178,000.00	9.85
3	210215	21 国开 15	2,700,000	270,864,000.00	7.00
4	019654	21 国债 06	1,408,510	140,893,255.30	3.64
5	188884	21 光证 10	800,000	80,080,000.00	2.07

### 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21交通银行小微债（2128013）的发行人，因理财业务和同业业务制度不健全、理财业务数据与事实不符、部分理财业务发展与监管导向不符、理财业务风险隔离不到位，利用本行表内自有资金为本行表外理财产品提供融资、理财资金违规投向土地储备项目等违规行为，于2021年7月13日被中国银行保险监督管理委员会处罚罚款4100万元。

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	111,669.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	40,204,120.03
5	应收申购款	75,467,795.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	115,783,584.87

## 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	113534	鼎胜转债	8,139,385.80	0.21
2	127006	敖东转债	7,846,005.60	0.20
3	113579	健友转债	7,762,336.00	0.20
4	128109	楚江转债	7,750,185.04	0.20
5	128029	太阳转债	7,739,802.00	0.20
6	110070	凌钢转债	7,721,246.70	0.20
7	110047	山鹰转债	7,689,547.20	0.20
8	123085	万顺转 2	7,678,295.91	0.20
9	127033	中装转 2	7,664,029.56	0.20
10	128135	洽洽转债	7,631,471.00	0.20
11	110076	华海转债	7,622,721.60	0.20
12	127018	本钢转债	7,483,233.42	0.19
13	113047	旗滨转债	7,175,503.20	0.19
14	128063	未来转债	7,004,651.50	0.18
15	123067	斯莱转债	2,820,627.00	0.07
16	110038	济川转债	2,790,189.50	0.07
17	123078	飞凯转债	2,731,781.00	0.07
18	123083	朗新转债	2,708,685.00	0.07
19	110048	福能转债	2,679,449.40	0.07
20	128096	奥瑞转债	2,668,170.54	0.07
21	113025	明泰转债	2,651,390.40	0.07
22	113525	台华转债	2,637,815.40	0.07
23	113585	寿仙转债	2,636,829.00	0.07
24	128017	金禾转债	2,630,356.80	0.07
25	123060	苏试转债	2,627,199.00	0.07
26	128113	比音转债	2,622,207.00	0.07
27	110061	川投转债	2,619,067.50	0.07
28	113615	金诚转债	2,612,797.00	0.07

29	118000	嘉元转债	2,606,662.80	0.07
30	128141	旺能转债	2,606,432.40	0.07
31	123063	大禹转债	2,604,449.36	0.07
32	123114	三角转债	2,604,217.60	0.07
33	110077	洪城转债	2,602,363.50	0.07
34	113598	法兰转债	2,599,965.80	0.07
35	113051	节能转债	2,599,632.00	0.07
36	110066	盛屯转债	2,598,264.00	0.07
37	128101	联创转债	2,596,896.00	0.07
38	113605	大参转债	2,595,652.70	0.07
39	113048	晶科转债	2,587,462.20	0.07
40	113584	家悦转债	2,586,962.40	0.07
41	123087	明电转债	2,586,025.20	0.07
42	123100	朗科转债	2,585,186.10	0.07
43	127015	希望转债	2,584,390.00	0.07
44	123091	长海转债	2,583,755.70	0.07
45	127032	苏行转债	2,583,538.76	0.07
46	113037	紫银转债	2,581,184.30	0.07
47	113011	光大转债	2,580,940.80	0.07
48	128105	长集转债	2,580,901.40	0.07
49	113516	苏农转债	2,579,486.40	0.07
50	128034	江银转债	2,579,458.05	0.07
51	128114	正邦转债	2,578,064.00	0.07
52	123056	雪榕转债	2,577,613.50	0.07
53	123064	万孚转债	2,577,211.00	0.07
54	128048	张行转债	2,576,989.65	0.07
55	128119	龙大转债	2,576,677.74	0.07
56	110073	国投转债	2,574,409.20	0.07
57	113044	大秦转债	2,574,028.80	0.07
58	127020	中金转债	2,573,626.60	0.07
59	123044	红相转债	2,572,219.00	0.07

60	123012	万顺转债	2,571,487.40	0.07
61	128097	奥佳转债	2,570,750.00	0.07
62	127016	鲁泰转债	2,570,406.30	0.07
63	128134	鸿路转债	2,570,356.86	0.07
64	123107	温氏转债	2,570,019.20	0.07
65	127012	招路转债	2,569,968.00	0.07
66	110053	苏银转债	2,569,595.60	0.07
67	127005	长证转债	2,568,386.70	0.07
68	113042	上银转债	2,566,892.90	0.07
69	110043	无锡转债	2,566,671.10	0.07
70	110045	海澜转债	2,565,371.40	0.07
71	113504	艾华转债	2,564,530.80	0.07
72	128026	众兴转债	2,564,502.60	0.07
73	123101	拓斯转债	2,564,453.10	0.07
74	113577	春秋转债	2,564,130.40	0.07
75	128137	洁美转债	2,563,578.30	0.07
76	123108	乐普转 2	2,563,246.04	0.07
77	123050	聚飞转债	2,562,401.60	0.07
78	123025	精测转债	2,561,428.30	0.07
79	113602	景 20 转债	2,560,231.00	0.07
80	128081	海亮转债	2,559,020.10	0.07
81	127030	盛虹转债	2,558,392.80	0.07
82	113013	国君转债	2,557,495.60	0.07
83	113621	彤程转债	2,557,461.60	0.07
84	127017	万青转债	2,557,007.80	0.07
85	110063	鹰 19 转债	2,556,532.80	0.07
86	127029	中钢转债	2,554,676.60	0.07
87	113599	嘉友转债	2,553,653.60	0.07
88	113049	长汽转债	2,553,541.20	0.07
89	123048	应急转债	2,551,708.50	0.07
90	128095	恩捷转债	2,550,489.30	0.07



91	113550	常汽转债	2,548,250.60	0.07
92	127011	中鼎转 2	2,547,155.60	0.07
93	113568	新春转债	2,537,891.40	0.07
94	123022	长信转债	2,536,180.50	0.07
95	123111	东财转 3	2,524,381.80	0.07
96	113545	金能转债	2,523,110.20	0.07
97	128046	利尔转债	2,520,555.58	0.07
98	123070	鹏辉转债	2,516,857.60	0.07
99	110074	精达转债	2,516,528.70	0.07
100	113597	佳力转债	2,501,941.50	0.06
101	110059	浦发转债	2,501,792.00	0.06
102	110064	建工转债	2,494,217.00	0.06
103	127038	国微转债	2,490,478.80	0.06
104	113537	文灿转债	2,466,960.10	0.06
105	123035	利德转债	2,459,055.78	0.06
106	113034	滨化转债	2,307,178.60	0.06
107	113026	核能转债	2,048,744.60	0.05
108	113616	韦尔转债	2,014,141.90	0.05
109	128021	兄弟转债	800,215.20	0.02

### 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	1,354,054,159.03
本报告期基金总申购份额	2,009,364,716.52
减：本报告期基金总赎回份额	197,116,648.51
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,166,302,227.04

## §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	2021/10/26-2021/11/4	154,679,040.99	447,526,551.31	-	602,205,592.30	19.02%

#### 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 106 只公募基金。截至 2021 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模超 1653 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。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”。

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。2021 年 9 月，由《中国证券报》主办的第十八届“中国基金业金牛奖”揭晓，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。

## §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  
二〇二二年一月二十二日