

**海富通大中华精选混合型证券投资基金**  
**2021 年中期报告**  
**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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

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 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告</b> .....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	35
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	36
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	36
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	39
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	42
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	42
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	42
7.11 投资组合报告附注.....	42
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	43

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	43
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>44</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>44</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	44
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
10.4 基金投资策略的改变 .....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	44
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.8 其他重大事件 .....	54
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>55</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>56</b>
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	56
12.3 查阅方式 .....	56

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通大中华精选混合型证券投资基金
基金简称	海富通大中华混合（QDII）
基金主代码	519602
交易代码	519602
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1月27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
报告期末基金份额总额	10,207,823.13 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于在海外证券市场交易的大中华公司的优质股票,追求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。
投资策略	本基金通过对全球宏观经济和大中华地区区域经济的基本面分析,采用自上而下的策略对资产进行有效资产配置;对股票的选择采用自下而上的“三站式”精选策略,挖掘定价合理,具备竞争优势的上市公司股票进行投资,并有效控制下行风险。
业绩比较基准	MSCI 金龙净总收益指数
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,属于中高风险水平的投资品种。同时,本基金投资的目标市场是海外市场,除了需要承担市场波动风险之外,本基金还面临汇率风险、国别风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	许俊
	联系电话	021-38650788	010-66594319
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942
注册地址		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	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴花园石	北京西城区复兴门内大街1号

	桥路66号东亚银行金融大厦 36-37层	
邮政编码	200120	100818
法定代表人	杨仓兵	刘连舸

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	-	中国银行（香港）有限公司
注册地址		-	香港花园道1号中银大厦
办公地址		-	香港花园道1号中银大厦
邮政编码		-	-

注：本基金无境外投资顾问。

## 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021年1月1日至2021年6月30日）
本期已实现收益	3,494,793.57
本期利润	2,213,832.09
加权平均基金份额本期利润	0.1926
本期加权平均净值利润率	11.78%
本期基金份额净值增长率	9.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	7,007,995.09
期末可供分配基金份额利润	0.6865
期末基金资产净值	17,215,818.22
期末基金份额净值	1.687

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	68.70%

注：1、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。

2、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。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	2.30%	0.92%	1.59%	0.80%	0.71%	0.12%
过去三个月	5.50%	1.21%	1.97%	0.93%	3.53%	0.28%
过去半年	9.97%	1.78%	5.20%	1.21%	4.77%	0.57%
过去一年	12.24%	1.73%	24.21%	1.14%	-11.97%	0.59%
过去三年	34.85%	1.62%	42.88%	1.15%	-8.03%	0.47%
自基金成立起至今	68.70%	1.47%	122.92%	1.09%	-54.22%	0.38%

#### 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

海富通大中华精选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  
 (2011年1月27日至2021年6月30日)



注：1、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，截至建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条（三）投资范围、（九）投资限制中规定的各项比例；

2、本基金按照全球投资表现标准（GIPS）计算和表述投资业绩。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 87 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期

行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通可转债优选债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通富祥混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金 (LOF)、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金 (FOF)、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通添鑫收益债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通惠增多策略一年定期开放灵活配

置混合型证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通惠睿精选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
高崢	本基金的基金经理	2018-09-21	-	13 年	经济学硕士。持有基金从业人员资格证书。历任德勤华永会计师事务所审计部职员，光大证券股份有限公司行业研究员，中金公司研究部执行总经理、化工行业研究团队负责人。2017 年 3 月加入海富通基金管理有限公司，历任权益投资部基金经理助理。2017 年 8 月起任海富通沪港深混合的基金经理。2018 年 9 月起兼任海富通大中华混合(QDII)、海富通中国海外混合(QDII)的基金经理。
陶意非	本基金的基金经理	2019-01-30	-	15 年	硕士。持有基金从业人员资格证书。历任花旗集团证券（日本）策略分析师、瑞穗证券(Mizuho Securities)交易员、顶峰资产管理有限公司（ASSET MANAGEMENT ONE Co., Ltd）基金经理、汇丰晋信基金管理有限公司首席港股策略师。2018 年 12 月加入海富通基金管理有限公司。2019 年 1 月任海富通大中华混合(QDII)、海富通中国海外混合(QDII)的基

					金经理。2021 年 6 月起兼任海富通中证港股通科技 ETF 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：自参加证券行业的相关工作开始计算。

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金无境外投资顾问。

#### 4.3 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。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 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 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的样本，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。

##### 4.4.2 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。

#### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2021 年上半年，包括港股和台股的大中华股票市场整体上涨，但波动较大。截至 2021 年

6月30日,恒生指数累计上涨5.86%,恒生国企指数则下跌0.70%,MSCI中国指数则小幅上涨1.23%,台湾加权指数上涨20.52%;相比同期沪深300指数、中小100和创业板指则分别上涨0.24%、3.66%和17.22%。

回顾上半年走势,在2020年全年受流动性驱动后,大中华股票市场在2021年迎来开门红,市场出现强劲上涨。大中华股票受益于再通胀交易,增长预期和风险偏好改善推动估值扩张。数以千亿的南下资金和海外资金快速流入香港市场。然而,这一现象在2月底戛然而止,大中华股票市场出现明显回调。截止二季度末,大中华股票市场在2021年上半年落后于发达市场和新兴市场。我们认为其中的一个原因是香港市场更易遭遇国内和国外政策不确定性带来的负面影响。投资风格方面,价值跑赢成长,主要是由于前期美债利率快速攀升、反垄断以及政府加大对民营教育的监管力度影响市场情绪,削弱了投资者对部分新经济龙头的投资信心。

分板块来看,医疗保健、能源及运输板块表现好于其它板块。与之相反,保险、必需消费、通讯服务等其它板块相对落后。

报告期内基金仍依据业绩及估值表现,寻求具有长期投资价值的股票,除了继续超配高等教育相关股票以及光学硬件龙头公司以外,买入成长确定性强的物业股;同时继续低配银行保险等金融板块以及互联网相关公司。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为9.97%,同期业绩比较基准收益率为5.20%,基金净值超过业绩比较基准4.77个百分点。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经历了今年上半年的“过山车”行情后,展望下半年,我们预计大中华股票市场有望逐步摆脱困境,尽管外部不确定性仍存。

企业盈利:中国“先进先出”,恢复常态;不均衡修复,增速或逐步趋缓。作为率先走出疫情并复苏的国家,我们预计中国将逐步回归常态。不过修复依然呈现明显的不均衡态势,例如国内消费维持相对低迷,同时作为拉动增长主要动力的外需仍将维持韧性,但年底前后也将逐渐趋缓,因此整体增长路径往前看将大概率趋缓并回归常态的过程。另外,上游价格冲高推动PPI与CPI剪刀差不断扩大,不仅反映了供需之间的错位,同时也将侵蚀下游需求和中下游企业的盈利能力。我们预计PPI与CPI剪刀差有望从高点逐步回落,但可能不会一蹴而就。尽管如此,2021年本身中国仍有望实现相对较高的经济增速。

估值:估值分化,但仍具吸引力。目前来看,港股市场整体估值依然处于历史平均水平,下行

空间相对有限，因此带来长线价值和吸引力。分板块来看，新老经济板块间估值分化以及成长板块和价值板块间的估值分化依然较为明显。另一方面，港股市场能源、银行和资本品等老经济板块估值低于 A 股市场同类板块，A/H 溢价幅度较大。与此同时，对比股票和债券，考虑到债券收益率未来可能持续处于较低水平，我们认为股票相对债券的吸引力正在上升。

**流动性：**港股资金面和流动性有望维持相对友好和宽松状态；关注美联储 QE 减量后的海外资金的边际变化。我们预计，在当前经济增长仍保持稳健且高杠杆等结构性问题仍是政策焦点的背景下，国内货币政策将保持基本稳定。不过，国内债券市场已经开始计入政策边际放松的可能性，反映为年初以来中国国债利率曲线整体下移且陡峭化。往前看，如果后续增长面临更大压力且外部不确定性随着美联储减量开启而增减，不排除国内有一定政策作为对冲。根据历史经验，影响港股资金面的两股资金，即南向资金和海外资金，主要分别受国内流动性和中国经济增长主导，综合分析，我们认为在美联储 QE 减量前整体流动性将会维持相对友好状态。另外，从中长期角度，大中华股票市场不断壮大的新经济格局将持续提升其对国内外资金的长期吸引力。

行业方面，在相关政策出台后，高教股的最大不确定性已经基本消除，在成长的高确定性，良好的现金流以及低估值吸引力下，我们认为高教股在中长期都具有较高投资价值。同时，能够轻资产快速成长，具有较高成长确定性并且现金流情况良好的物业股也值得长期关注。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括分管基金运营业务的高级管理人员、分管投资业务的高级管理人员、督察稽核部负责人、风险管理部负责人、研究部负责人及基金运营部负责人等，以上人员具有丰富的合规、风控、证券研究、会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会对经济环境发生重大变化或发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金运营部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 6 次，每

次基金收益分配比例不低于可供分配利润的 20%。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自 2018 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 30 日，已连续超过六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人拟通过基金转型的方式解决。解决方案已根据法规要求向中国证券监督管理委员会进行了报告。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对海富通大中华精选混合型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：海富通大中华精选混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,696,521.60	2,313,413.85
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	15,702,132.03	22,083,786.87
其中：股票投资		15,702,132.03	22,083,786.87
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		297,233.64	345,592.57
应收利息	6.4.7.5	41.36	109.70
应收股利		14,719.13	-
应收申购款		32,373.18	46,321.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	21,375.31	-
<b>资产总计</b>		<b>17,764,396.25</b>	<b>24,789,224.24</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		497,167.05	1,037,027.85
应付管理人报酬		25,599.65	35,050.58
应付托管费		4,266.58	5,841.76
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	21,544.75	53,309.09
<b>负债合计</b>		<b>548,578.03</b>	<b>1,131,229.28</b>
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	10,207,823.13	15,425,022.27
未分配利润	6.4.7.10	7,007,995.09	8,232,972.69

所有者权益合计		17,215,818.22	23,657,994.96
负债和所有者权益总计		17,764,396.25	24,789,224.24

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.687 元，基金份额总额 10,207,823.13 份。

## 6.2 利润表

会计主体：海富通大中华精选混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>2,567,886.45</b>	<b>4,018,973.62</b>
1.利息收入		1,724.31	4,244.60
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,724.31	4,244.60
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,891,575.01	2,705,499.64
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,791,031.20	2,617,561.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	100,543.81	87,938.12
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,280,961.48	1,275,934.23
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-59,590.09	17,587.48
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	15,138.70	15,707.67
<b>减：二、费用</b>		<b>354,054.36</b>	<b>359,704.53</b>
1. 管理人报酬		168,343.22	192,619.00
2. 托管费		28,057.23	32,103.16
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	115,325.03	106,725.79
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.19	42,328.88	28,256.58
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>2,213,832.09</b>	<b>3,659,269.09</b>

减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>2,213,832.09</b>	<b>3,659,269.09</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通大中华精选混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	15,425,022.27	8,232,972.69	23,657,994.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,213,832.09	2,213,832.09
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-5,217,199.14	-3,438,809.69	-8,656,008.83
其中：1.基金申购款	3,071,661.60	1,958,840.93	5,030,502.53
2.基金赎回款	-8,288,860.74	-5,397,650.62	-13,686,511.36
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	10,207,823.13	7,007,995.09	17,215,818.22
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	19,521,362.73	5,175,112.16	24,696,474.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,659,269.09	3,659,269.09
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-5,116,383.16	-1,585,981.24	-6,702,364.40
其中：1.基金申购款	9,321,333.79	3,227,641.12	12,548,974.91
2.基金赎回款	-14,437,716.95	-4,813,622.36	-19,251,339.31
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	14,404,979.57	7,248,400.01	21,653,379.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：任志强，主管会计工作负责人：胡光涛，会计机构负责人：胡正万

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

海富通大中华精选混合型证券投资基金(原名为海富通大中华精选股票型证券投资基金，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会证监许可[2010]1760 号文核准，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通大中华精选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 821,474,865.11 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 15 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通大中华精选股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 1 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 821,766,293.97 份基金份额，其中认购资金利息折合 291,428.86 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，海富通大中华精选股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 7 日公告后更名为海富通大中华精选混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《海富通大中华精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括股票、存托凭证、交易型开放式指数基金(ETF)等权益类证券和银行存款、现金、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金以全球除内地股票市场以外的具有“大中华概念”上市公司为主要投资对象。“大中华概念”的股票需满足以下三个条件之一：1)上市公司注册在大中华区域(中国内地、香港、台湾、澳门)；2)上市公司中至少百分之三十股权(占总股本)由大中华区域的股东持有；3)公司最近一个会计年度至少百分之五十之营业额来自大中华区域。本基金的投资比例为：股票及其他权益类证券占基金资产的 60%-95%；现金、银行存款、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%—40%，其中基金保留的现金的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：MSCI 金龙净总收益指数(MSCI Golden Dragon Net Total Return Index)。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2021 年 8 月 30 日批准报出。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通大中华精选混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2021 年 6 月 30 日,本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形,基金管理人拟通过基金转型的方式解决。解决方案已根据法规要求向中国证券监督管理委员会进行了报告。故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2021 年 6 月 30 日
活期存款	1,696,521.60
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,696,521.60

注：于 2021 年 6 月 30 日，活期存款中包括的外币余额为：港币活期存款 1,599,851.19（折合人民币 1,331,204.18 元）；台币活期存款 59,483.00（折合人民币 13,786.32 元）；美金活期存款 872.51（折合人民币 5,636.51 元）。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	14,364,642.96	15,702,132.03	1,337,489.07
贵金属投资-金交所黄	-	-	-

金合约				
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	14,364,642.96	15,702,132.03	1,337,489.07	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	41.36
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	41.36

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日

其他应收款	21,375.31
待摊费用	-
合计	21,375.31

#### 6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末应付交易费用无余额。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,708.96
应付证券出借违约金	-
预提费用	19,835.79
合计	21,544.75

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,425,022.27	15,425,022.27
本期申购	3,071,661.60	3,071,661.60
本期赎回（以“-”号填列）	-8,288,860.74	-8,288,860.74
本期末	10,207,823.13	10,207,823.13

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,674,005.14	558,967.55	8,232,972.69
本期利润	3,494,793.57	-1,280,961.48	2,213,832.09
本期基金份额交易产生的变动数	-3,174,764.18	-264,045.51	-3,438,809.69
其中：基金申购款	2,048,536.28	-89,695.35	1,958,840.93
基金赎回款	-5,223,300.46	-174,350.16	-5,397,650.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,994,034.53	-986,039.44	7,007,995.09

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	1,723.21
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	1.10
合计	1,724.31

**6.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	32,704,712.31
减：卖出股票成本总额	28,913,681.11
买卖股票差价收入	3,791,031.20

**6.4.7.13 债券投资收益**

本基金本报告期末投资债券。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	100,543.81
基金投资产生的股利收益	-
合计	100,543.81

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-1,280,961.48

——股票投资	-1,280,961.48
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-1,280,961.48

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	15,138.70
合计	15,138.70

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	115,325.03
银行间市场交易费用	-
合计	115,325.03

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	-
银行汇划费	765.00
其他费用	21,728.09
合计	42,328.88

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国银行(香港)有限公司(“中银香港”)	基金境外资产托管人
海通国际证券有限公司(“海通国际”)	基金管理人的股东的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通国际	17,271,187.01	30.56%	-	-

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

海通国际	17,271.20	30.68%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
海通国际	-	-	-	-

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	168,343.22	192,619.00
其中：支付销售机构的客户维护费	75,016.10	89,867.29

注：支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.8% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.8\% / \text{当年天数}。$$

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	28,057.23	32,103.16

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.30\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中银香港	1,331,437.40	-0.70	820,161.24	-
中国银行	346,203.83	1,722.82	2,294,822.27	4,243.18

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明****6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期末未实施利润分配。

**6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
3800 HK	GCL-P OLY	2021-04-01	重大事项未公	1.65	-	-	372,000	471,636.40	612,876.84	-

	ENERGY		告							
--	--------	--	---	--	--	--	--	--	--	--

注：本基金截至 2021 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌

牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计及风险管理委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理政策。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部和督察稽核部及相关业务部门风险管理责任人构成的三层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行以及境外次托管行中银香港，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资 (2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有同一家银行的存款不得超过本基金净值的 20% (在基金托管账户的存款可以不受上述限制)，本基金持有同一机构 (政府、国际金融组织除外) 发行的证券市值不得超过基金净值的

10%。) 本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 3.56%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,696,521.60	-	-	-	1,696,521.60
交易性金融资产	-	-	-	15,702,132.03	15,702,132.03
应收股利	-	-	-	14,719.13	14,719.13
应收证券清算款	-	-	-	297,233.64	297,233.64
应收利息	-	-	-	41.36	41.36
应收申购款	-	-	-	32,373.18	32,373.18
其他应收款	-	-	-	21,375.31	21,375.31
资产总计	1,696,521.60	-	-	16,067,874.65	17,764,396.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	497,167.05	497,167.05
应付管理人报酬	-	-	-	25,599.65	25,599.65
应付托管费	-	-	-	4,266.58	4,266.58
其他负债	-	-	-	21,544.75	21,544.75
负债总计	-	-	-	548,578.03	548,578.03
利率敏感度缺口	1,696,521.60	-	-	15,519,296.62	17,215,818.22
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,313,413.85	-	-	-	2,313,413.85
交易性金融资产	-	-	-	22,083,786.87	22,083,786.87
应收证券清算款	-	-	-	345,592.57	345,592.57
应收利息	-	-	-	109.70	109.70
应收申购款	-	-	-	46,321.25	46,321.25
资产总计	2,313,413.85	-	-	22,475,810.39	24,789,224.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,037,027.85	1,037,027.85
应付管理人报酬	-	-	-	35,050.58	35,050.58
应付托管费	-	-	-	5,841.76	5,841.76
其他负债	-	-	-	53,309.09	53,309.09
负债总计	-	-	-	1,131,229.28	1,131,229.28

利率敏感度缺口	2,313,413.85	-	-	21,344,581.11	23,657,994.96
---------	--------------	---	---	---------------	---------------

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2020 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	5,636.51	1,331,204.18	13,786.32	1,350,627.01
交易性金融资产	281,091.87	15,421,040.16	-	15,702,132.03
应收股利	-	9,367.83	-	9,367.83
应收证券清算款	-	297,233.64	-	297,233.64
资产合计	286,728.38	17,058,845.81	13,786.32	17,359,360.51
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净	286,728.38	17,058,845.81	13,786.32	17,359,360.51

额				
项目	上年度末 2020年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	27,744.92	1,645,926.27	13,814.77	1,687,485.96
交易性金融资产	-	22,083,786.87	-	22,083,786.87
应收证券清算款	-	345,592.57	-	345,592.57
资产合计	27,744.92	24,075,305.71	13,814.77	24,116,865.40
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	27,744.92	24,075,305.71	13,814.77	24,116,865.40

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	867,968.03	1,205,843.27
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-867,968.03	-1,205,843.27	

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波

动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票及其他权益类证券占基金资产的 60%-95%，银行存款及现金等高流动性资产占基金资产的 5%-40%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	15,702,132.03	91.21	22,083,786.87	93.35
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	15,702,132.03	91.21	22,083,786.87	93.35

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	687,886.90	1,104,948.97

2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-687,886.90	-1,104,948.97
--------------------------	-------------	---------------

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	15,702,132.03	88.39
	其中：普通股	15,421,040.16	86.81
	存托凭证	281,091.87	1.58
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,696,521.60	9.55
8	其他各项资产	365,742.62	2.06
9	合计	17,764,396.25	100.00

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
--------	------	---------------

中国香港	15,421,040.16	89.57
美国	281,091.87	1.63
合计	15,702,132.03	91.21

注：国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	4,689,096.15	27.24
房地产	2,979,299.89	17.31
信息技术	2,799,340.38	16.26
工业	2,102,716.08	12.21
医疗保健	1,171,049.42	6.80
通信服务	781,822.37	4.54
原材料	598,431.94	3.48
日常消费品	580,375.80	3.37
合计	15,702,132.03	91.21

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量（股）	公允价值	占基金资 产净值比 例（%）
1	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学 科技(集团) 有限公司	2382 HK	香港联 合交易 所	香港	5,600	1,143,477.62	6.64
2	COUNTR Y GARDEN SERVICE S	碧桂园服 务控股有 限公司	6098 HK	香港联 合交易 所	香港	14,000	977,361.17	5.68
3	NEUSOF T EDUCAT ION TECHNO LOGY	东软教育 科技有限 公司	9616 HK	香港联 合交易 所	香港	170,400	863,479.37	5.02
4	CHINA	华润万象	1209 HK	香港联	香港	19,000	840,275.99	4.88

	RESOURCES MIXC LIFESTY	生活有限公司		合交易所				
5	HOPE EDUCATION	希望教育集团有限公司	1765 HK	香港联合交易所	香港	538,000	837,122.40	4.86
6	CATHAY MEDIA AND EDUCATION	华夏视听教育集团	1981 HK	香港联合交易所	香港	174,000	781,822.37	4.54
7	EDVANTAGE GROUP HOLDINGS LTD	中汇集团控股有限公司	382 HK	香港联合交易所	香港	98,000	634,411.08	3.69
8	CHINA NEW HIGHER	中国新高教集团有限公司	2001 HK	香港联合交易所	香港	139,000	615,306.52	3.57
9	GCL-POLY ENERGY	保利协鑫能源控股有限公司	3800 HK	香港联合交易所	香港	372,000	612,876.84	3.56
10	XINTE ENERGY C-H	新特能源股份有限公司	1799 HK	香港联合交易所	香港	43,600	605,854.09	3.52
11	GANFENG LITHIUM	江西赣锋锂业股份有限公司	1772 HK	香港联合交易所	香港	6,200	598,431.94	3.48
12	SMIC	中芯国际集成电路制造有限公司	981 HK	香港联合交易所	香港	29,500	586,658.00	3.41
13	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	华润啤酒(控股)有限公司	291 HK	香港联合交易所	香港	10,000	580,375.80	3.37
14	CHINA YUHUA EDUCATION CORPL	中国宇华教育集团有限公司	6169 HK	香港联合交易所	香港	98,000	573,253.20	3.33
15	CHINA	中国教育	839 HK	香港联	香港	38,000	547,641.77	3.18

	EDUCATION GROUP	集团控股有限公司		合交易所				
16	CENTRAL CHINA NEW LIFE LTD	建业新生活有限公司	9983 HK	香港联合交易所	香港	77,000	505,513.56	2.94
17	SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	世茂服务控股有限公司	873 HK	香港联合交易所	香港	21,000	469,168.31	2.73
18	YUEXIU SERVICES GROUP LTD	越秀服务集团有限公司	6626 HK	香港联合交易所	香港	95,000	438,714.18	2.55
19	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	石药集团有限公司	1093 HK	香港联合交易所	香港	46,000	430,218.64	2.50
20	NEW HORIZON HEALTH LTD	诺辉健康	6606 HK	香港联合交易所	香港	6,000	395,404.42	2.30
21	JINKE SMART SERVICES GROUP-H	金科智慧服务集团股份有限公司	9666 HK	香港联合交易所	香港	5,600	339,455.36	1.97
22	L.K. TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	力劲科技集团有限公司	558 HK	香港联合交易所	香港	25,000	336,576.36	1.96
23	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	福耀玻璃工业集团股份有限公司	3606 HK	香港联合交易所	香港	6,800	309,500.48	1.80
24	TUYA	涂鸦智能	TUYA US	美国证	美国	1,776	281,091.87	1.63

	INC	公司		券交易所				
25	WUXI BIOLOGI CS CAYMA N INC	药明生物 技术有限 公司	2269 HK	香港联 合交易 所	香港	2,000	236,809.97	1.38
26	ESR CAYMA N LTD	ESR Cayman Limited	1821 HK	香港联 合交易 所	香港	9,800	213,644.86	1.24
27	Q TECHNO LOGY GROUP CO LTD	丘钛科技 (集团)有限 公司	1478 HK	香港联 合交易 所	香港	14,000	185,453.99	1.08
28	VOBILE GROUP LTD	阜博集团 有限公司	3738 HK	香港联 合交易 所	香港	6,000	175,236.05	1.02
29	SINO-OC EAN SERVICE HOLDIN G L	远洋服务 控股有限 公司	6677 HK	香港联 合交易 所	香港	34,500	172,527.63	1.00
30	SHANGH AI GENCH EDUCAT ION GRO	上海建桥 教育集团 有限公司	1525 HK	香港联 合交易 所	香港	24,500	122,927.34	0.71
31	WUAPPT EC CO LT-H	无锡药明 康德新药 开发股份 有限公司	2359 HK	香港联 合交易 所	香港	720	108,616.39	0.63
32	EVER SUNSHI NE LIFESTY LE SERV	旭辉永升 服务集团 有限公司	1995 HK	香港联 合交易 所	香港	6,000	96,255.01	0.56
33	SHOUCH ENG HOLDIN GS LTD	首程控股 有限公司	697 HK	香港联 合交易 所	香港	56,000	86,669.45	0.50

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比例 （%）
1	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	1209 HK	1,550,605.39	6.55
2	CHINA MOBILE LTD	941 HK	1,010,466.71	4.27
3	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	762 HK	924,311.39	3.91
4	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	1800 HK	907,281.65	3.83
5	EDVANTAGE GROUP HOLDINGS LTD	382 HK	845,462.32	3.57
6	SMIC	981 HK	724,172.52	3.06
7	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	717,416.11	3.03
8	CHINA EDUCATION GROUP	839 HK	716,016.00	3.03
9	CHINA TELECOM CORP LTD-H	728 HK	676,774.18	2.86
10	CHINA NEW HIGHER	2001 HK	667,421.54	2.82
11	COUNTRY GARDEN SERVICES	6098 HK	659,227.37	2.79
12	XINTE ENERGY C-H	1799 HK	613,558.63	2.59
13	CATHAY MEDIA AND EDUCATION	1981 HK	587,990.85	2.49
14	HOPE EDUCATION	1765 HK	587,850.37	2.48
15	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	549,309.18	2.32
16	GANFENG LITHIU-H	1772 HK	526,734.85	2.23
17	CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	6169 HK	522,920.51	2.21
18	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	1347 HK	520,938.49	2.20
19	JD.COM INC - CL A	9618 HK	517,876.59	2.19
20	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1093 HK	509,811.04	2.15
21	XIAOMI CORP-CLASS B	1810 HK	506,420.93	2.14
22	CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	291 HK	499,673.38	2.11
23	JINKE SMART SERVICES GROUP-H	9666 HK	484,778.33	2.05

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	XIAOMI CORP-CLASS B	1810 HK	1,615,934.97	6.83
2	WUAPPTEC CO LT-H	2359 HK	1,411,766.77	5.97
3	JINKE SMART SERVICES GROUP-H	9666 HK	1,389,833.35	5.87
4	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	285 HK	1,387,085.54	5.86
5	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2269 HK	1,240,909.66	5.25
6	EDVANTAGE GROUP HOLDINGS LTD	382 HK	1,230,763.08	5.20
7	CHINA MOBILE LTD	941 HK	1,213,582.84	5.13
8	COUNTRY GARDEN SERVICES	6098 HK	1,089,082.43	4.60
9	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	762 HK	1,006,676.48	4.26
10	PHARMARON BEIJING CO LTD-H	3759 HK	1,000,917.60	4.23
11	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	1800 HK	913,997.69	3.86
12	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	1209 HK	863,739.09	3.65
13	ESR CAYMAN LTD	1821 HK	850,424.26	3.59
14	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	769,837.72	3.25
15	SHOUCHENG HOLDINGS LTD	697 HK	759,183.83	3.21
16	CATHAY MEDIA AND EDUCATION	1981 HK	736,925.65	3.11
17	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	3606 HK	734,592.63	3.11
18	CHINA TELECOM CORP LTD-H	728 HK	725,315.96	3.07
19	POWERLONG COMMERCIAL MANAGEM	9909 HK	714,808.43	3.02
20	SITC	1308 HK	713,462.58	3.02
21	Q TECHNOLOGY GROUP CO LTD	1478 HK	706,649.71	2.99
22	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	688,062.87	2.91
23	HAINAN MEILAN INTERNATIONA-H	357 HK	665,310.52	2.81
24	SMIC	981 HK	621,971.96	2.63
25	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1093 HK	615,871.40	2.60
26	MAN WAH HOLDINGS LTD	1999 HK	584,609.72	2.47
27	GCL-POLY ENERGY	3800 HK	578,704.81	2.45
28	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	1347 HK	508,677.01	2.15
29	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9988 HK	504,006.19	2.13
30	MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	909 HK	499,336.67	2.11
31	BAIDU INC - SPON ADR	BIDU US	491,880.66	2.08
32	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	475,478.17	2.01

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	23,812,987.79
卖出收入（成交）总额	32,704,712.38

注：“买入成本”、“卖出收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

#### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

#### 7.11 投资组合报告附注

**7.11.1** 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。

**7.11.2** 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。

#### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	297,233.64
3	应收股利	14,719.13
4	应收利息	41.36
5	应收申购款	32,373.18
6	其他应收款	21,375.31

7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	365,742.62

#### 7.11.4 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。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	3800 HK	GCL-POLY ENERGY	612,876.84	3.56	重大事项未 公告

### §8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
4,397	2,321.54	0.00	0.00%	10,207,823.13	100.00%

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,930.81	0.0287%

#### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 1 月 27 日）基金份额总额	821,766,293.97
本报告期期初基金份额总额	15,425,022.27
本报告期基金总申购份额	3,071,661.60
减：本报告期基金总赎回份额	8,288,860.74
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	10,207,823.13

## §10 重大事件揭示

## 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金的管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
CCB International	-	1,992,823.15	3.53%	6,268.23	11.14%	-

Securities Limited						
China International Capital Corp.HK	-	5,407,252.73	9.57%	6,980.25	12.40%	-
China Renaissance Securities (HK) Limited	-	6,641,586.62	11.75%	6,641.60	11.80%	-
CITIC Securities International Company Limited	-	2,927,071.33	5.18%	3,512.51	6.24%	-
GOLDMAN SACHS (ASIA) SECURITIES LIMITED	-	965,817.61	1.71%	1,448.73	2.57%	-
Haitong International Securities Company Limited	-	17,271,187.01	30.56%	17,271.20	30.68%	-
ICBC INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED	-	778,280.55	1.38%	778.29	1.38%	-
UBS Securities Asia Limited	-	2,187,947.62	3.87%	2,187.95	3.89%	-
UOB Kay Hian (HongKong) Limited	-	4,060,978.45	7.19%	4,060.98	7.21%	-
Daiwa Capital Markets HK Ltd	-	10,657,931.52	18.86%	5,329.01	9.47%	-
Mizuho Securities Asia Limited	-	3,626,823.53	6.42%	1,813.40	3.22%	-
BOCOM	-	-	-	-	-	-

International Securities Limited						
China Industriail Securities	-	-	-	-	-	-
China Merchants Sec (HK) Co Ltd	-	-	-	-	-	-
MasterLink Securities Corp.	-	-	-	-	-	-
SINOLINK SECURITIE S(HK)	-	-	-	-	-	-
YUANTA SECURITIE S (HONG KONG)COMPANY LIMITED	-	-	-	-	-	-
First Shanghai Securities Limited	-	-	-	-	-	-
ShenYin WanGuo (H.K.)Limite d	-	-	-	-	-	-
Deutsche Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-
Cathay Securities Corporation	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY CO. INTERNATI ONAL PLC	-	-	-	-	-	-
The Bank of New York Company Inc.	-	-	-	-	-	-

BOCI Security Ltd	-	-	-	-	-	-
KGI Asia Limited	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse (Hong Kong) Ltd	-	-	-	-	-	-
Fubon Bank (HK) Ltd.	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas Securities (Asia) Ltd	-	-	-	-	-	-
China Everbright Securities(H K) Limited	-	-	-	-	-	-
Guodu Securities(Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-
Nomura Securities (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-
Orient Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
Essence International Securities Ltd	-	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金未新增交易单元。

## 2、(1)交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行主观性评议，形成证券公司交易单元租用意见。

## (2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

<1> 推荐。投资部业务人员推荐，经投资部部门会议讨论，形成证券公司交易单元租用意见，并报公司总经理办公会核准。

<2> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后，由基金管理人的总经理办公会核准。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
CCB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corp. HK	-	-	-	-	-	-	-	-
China Renaissance Securities (HK) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CITI C Securities International Com	-	-	-	-	-	-	-	-

pany Limit ed								
GOL DMA N SAC HS (ASI A) SEC URIT IES LIMI TED	-	-	-	-	-	-	-	-
Haito ng Inter natio nal Secur ities Com pany Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
ICBC INTE RNA TIO NAL SEC URIT IES LIMI TED	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Secur ities Asia Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
UOB Kay Hian	-	-	-	-	-	-	-	-

(Hong Kong) Limited									
Daiwa Capital Markets HK Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Mizuho Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BOC OM International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
China Industrial Securities	-	-	-	-	-	-	-	-	-
China Merchants Sec (HK) Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Mast erLin	-	-	-	-	-	-	-	-	-

k Secur ities Corp.									
SINO LIN K SEC URIT IES( HK)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
YUA NTA SEC URIT IES (HO NG KON G)C OMP ANY LIMI TED	-	-	-	-	-	-	-	-	-
First Shan ghai Secur ities Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Shen Yin Wan Guo (H.K. )Limi ted	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Deuts che Secur ities Asia Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Cathay Securities Corporation	-	-	-	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY CO. INTERNATIONAL PLC	-	-	-	-	-	-	-	-
The Bank of New York Company Inc.	-	-	-	-	-	-	-	-
BOC I Security Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
KGI Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse (Hong Kong) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Fubon	-	-	-	-	-	-	-	-

Bank (HK) Ltd.								
BNP Paribas Securities (Asia) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
China Everbright Securities (HK) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Guodu Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Nomura Securities (HK) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-

Orient Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Essence International Securities Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-01
2	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加中国银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-01
3	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加平安银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-05
4	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-06
5	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-25
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国盛证券有限责任公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-26
7	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东吴证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-05

8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增甬兴证券有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-18
9	海富通基金管理有限公司关于网上直销平台开通中国工商银行快捷支付业务并开展申购费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-22
10	海富通基金管理有限公司关于调整网上直销金账户业务并实施费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-22
11	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30
12	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-27
13	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加招商银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-06
14	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-15
15	海富通大中华精选混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回、定期定额投资业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-28

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 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”。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准设立海富通大中华精选混合型证券投资基金的文件
- （二）海富通大中华精选混合型证券投资基金基金合同
- （三）海富通大中华精选混合型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通大中华精选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）报告期内海富通大中华精选混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

### 12.2 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。

### 12.3 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

二〇二一年八月三十一日