

海富通富盈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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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

| | |
|--|----|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| §2 基金简介 | 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..... | 6 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| §4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明..... | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 12 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 15 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 16 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 16 |
| 4.8 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..... | 16 |
| §5 托管人报告 | 16 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明..... | 16 |
| 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..... | 16 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 17 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 17 |
| 6.1 资产负债表..... | 17 |
| 6.2 利润表..... | 18 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 19 |
| 6.4 报表附注..... | 20 |
| §7 投资组合报告 | 48 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 48 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 48 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 49 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 55 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 57 |
| 7.6 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..... | 57 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 58 |
| 7.8 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贵金属投资明细..... | 58 |
| 7.9 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..... | 58 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 58 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 58 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 59 |
| §8 基金份额持有人信息 | 61 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 61 |

| | |
|---|-----------|
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 61 |
| 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 | 61 |
| §9 开放式基金份额变动 | 61 |
| §10 重大事件揭示 | 62 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 62 |
| 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 | 62 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 62 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 62 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 62 |
| 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 | 62 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 62 |
| 10.8 其他重大事件 | 63 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 65 |
| §12 备查文件目录 | 66 |
| 12.1 备查文件目录 | 66 |
| 12.2 存放地点 | 66 |
| 12.3 查阅方式 | 66 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|------------------|------------------|
| 基金名称 | 海富通富盈混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 海富通富盈混合 | |
| 基金主代码 | 009154 | |
| 交易代码 | 009154 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2020 年 5 月 20 日 | |
| 基金管理人 | 海富通基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 622,542,266.91 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 海富通富盈混合 A | 海富通富盈混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 009154 | 009155 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 201,740,435.76 份 | 420,801,831.15 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳定回报。 |
| 投资策略 | <p>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。</p> <p>债券投资主要采取利率策略、信用策略、收益率曲线策略以及杠杆策略，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。另外，本基金投资策略还包括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、股票期权投资策略。</p> |
| 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。 |

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 | 兴业银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 岳冲 | 曾麓燕 |
| | 联系电话 | 021-38650788 | 021-52629999-212040 |
| | 电子邮箱 | chongyue@hftfund.com | zengluyan@cib.com.cn |
| 客户服务电话 | | 40088-40099 | 95561 |
| 传真 | | 021-33830166 | 021-62535823 |
| 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 | 福建省福州市湖东路154号 |
| 办公地址 | | 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 | 上海市银城路167号4楼 |
| 邮政编码 | | 200120 | 200041 |
| 法定代表人 | | 杨仓兵 | 陶以平 |

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|-------------|--|
| 注册登记机构 | 海富通基金管理有限公司 | 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 |

§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） | |
|---------------|---------------------------|---------------|
| | 海富通富盈混合 A | 海富通富盈混合 C |
| 本期已实现收益 | 17,085,261.38 | 27,068,636.97 |
| 本期利润 | 12,343,757.51 | 16,050,613.67 |

| | | |
|----------------------|-------------------------|----------------|
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0400 | 0.0326 |
| 本期加权平均净值利润率 | 3.72% | 3.05% |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.80% | 2.60% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021年6月30日) | |
| | 海富通富盈混合 A | 海富通富盈混合 C |
| 期末可供分配利润 | 17,128,212.25 | 33,687,676.35 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0849 | 0.0801 |
| 期末基金资产净值 | 218,868,648.01 | 454,489,507.50 |
| 期末基金份额净值 | 1.0849 | 1.0801 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2021年6月30日) | |
| | 海富通富盈混合 A | 海富通富盈混合 C |
| 基金份额累计净值增长率 | 8.49% | 8.01% |

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

海富通富盈混合 A

| 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 | 0.23% | 0.19% | -0.31% | 0.15% | 0.54% | 0.04% |
| 过去三个月 | 1.95% | 0.23% | 0.92% | 0.18% | 1.03% | 0.05% |
| 过去六个月 | 2.80% | 0.39% | 0.95% | 0.24% | 1.85% | 0.15% |
| 过去一年 | 8.19% | 0.31% | 4.02% | 0.23% | 4.17% | 0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | 8.49% | 0.30% | 3.76% | 0.23% | 4.73% | 0.07% |

海富通富盈混合 C

| 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 | 0.19% | 0.18% | -0.31% | 0.15% | 0.50% | 0.03% |
| 过去三个月 | 1.85% | 0.23% | 0.92% | 0.18% | 0.93% | 0.05% |
| 过去六个月 | 2.60% | 0.39% | 0.95% | 0.24% | 1.65% | 0.15% |
| 过去一年 | 7.75% | 0.31% | 4.02% | 0.23% | 3.73% | 0.08% |

| | | | | | | |
|------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | 8.01% | 0.30% | 3.76% | 0.23% | 4.25% | 0.07% |
|------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|

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

海富通富盈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

(2020年5月20日至2021年6月30日)

海富通富盈混合 A



海富通富盈混合 C



注：本基金合同于 2020 年 5 月 20 日生效。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金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 | | |
| 杜晓海 | 本基金的基金经理；量化投资部总监。 | 2020-05-20 | - | 21 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。 |
| 夏妍妍 | 本基金的基金经理 | 2020-05-20 | - | 6 年 | 上海交通大学经济学硕士,持有基金从业人员资格证书。历任西门子金融服务集团西门子管理培训生,西门子财务租赁有限公司上海分公司高级财务分析师,2014 年加入海富通基金管理有限公司,历任固定收益投资部固定收益分析师、基金经理助理。2018 年 1 月起任海富通欣益混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通一年定期开放债券基金经理。2018 年 4 月至 2021 年 5 月任海富通融丰定开债券基金经理。2019 年 5 月起兼任海富通安颐收益混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通聚合纯债、海富通富祥混合及海富通瑞合纯债的基金经理。2019 年 10 月至 2020 年 11 月任海富通瑞丰债券基金经理。2020 年 5 月起兼任海富通富盈混合基金经理。2021 年 5 月起兼任海富通美元债(QDII)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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 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。

4.3.2 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，全球各大经济体从疫情中逐渐复苏，虽然路径有所曲折但经济活力显著增加。由于全球供应链还在恢复中，全球流动性释放充分，大宗商品价格涨幅最为显著。海外需求强劲但海运费用涨幅惊人，出口企业盈利增长受到相当制约。相对外需，国内需求稍显疲弱，日益上涨的原材料压缩中游制造业利润。消费服务业复苏态势确立但强度较弱，新经济（新消费）增长态势显著高于旧经济。资本市场担忧的全球货币紧缩在上半年没有得到应验。

市场整体走势如同 N 字型态势，风格出现明显变化。春节前，核心资产为主的“茅指数”领涨，春节后担心美债利率上行和货币政策转向，核心资产领跌。五月以来，十年期国债利率继续下行带来成长股反弹。尤其是降准以来，市场风格向成长板块继续偏移。上半年 A 股主要指数方面，上证指数上涨 3.40%，沪深 300 上涨 0.24%，中证 800 上涨 1.72%，中小综指上涨 5.19%，创业板指上涨 17.22%。分行业看，周期和医药行业领涨，钢铁、化工、煤炭、综合和医药分别上涨 26.34%、19.12%、18.33%、16.93% 和 16.10%；非银金融和军工通信明显落后，非银金融、国防军工、农林牧渔、通信和综合金融分别下跌 11.02%、8.46%、7.84%、3.35% 和 2.88%。

从上半年市场内部的结构看，周期和成长交相呼应成为市场两条主线。周期主线在一季度演绎得淋漓尽致，尤其在碳达峰的政策预期下，与此匹配的是相关行业上半年的业绩表现。同样是业绩靓丽的电动车产业链和半导体，五月以来行情同样演绎得如火如荼。消费领域除了医药 CXO 和次高端白酒，整体表现较弱。市场上半年赚钱效应明显，小盘股表现优于大盘股，核心资产相对疲弱。市场交易集中度有所下降，双创指数表现靓丽。整个市场反映出经济结构转型带来的红利，中国优

势供应链成为市场配置热点。

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。

债券方面, 从经济基本面来看, 2021 年上半年国内经济延续修复, 但恢复动能有所放缓。1-6 月工业增加值、固定资产投资、社会消费品零售总额分别累计同比上升 15.9%、12.6%与 23%, 较 1-3 月累计增速分别回落 8.6、13 与 10.9 个百分点。2 季度实际 GDP 同比增速为 7.9%, 两年复合平均增速为 7.4%。通胀方面, 受到食品类价格尤其是猪肉价格连续数月环比回落超过 10%的影响, 3 月以来 CPI 环比均为负, 受到 PPI 上行带动, CPI 同比有所走高, 但受到下游涨价能力有限的影响, PPI 向 CPI 传导不畅, 6 月同比上涨 1.2%, 较 5 月回落 0.2 个百分点。受到疫情后供需错配的影响, 以铜、油、黑色系为代表的工业品价格明显上升, 5 月 PPI 同比上涨 9%达到高点, 但随着国家各部委采取行动抑制工业品价格上涨, 同时与原油相关需求较弱, 6 月 PPI 环比涨幅回落至 0.3%, 同比上涨 8.8%, 较上月回落 0.2 个百分点。资金面与流动性方面, 年初以来受到央行公开市场操作净回笼的影响, 1 月下旬资金价格飙升, 7 天期银行间回购利率周度平均在 3.9%附近。春节跨季之后央行持续维持资金面平稳宽松的状态, 跨半年末央行小幅净投放, 对流动性明显呵护。在这种背景下, 债市总体呈现区间震荡, 利率先上后下, 但十年期国债收益率始终维持在 3.0%-3.3%的区间内波动。从去年年底到 6 月 30 日, 10 年期国债收益率累计下行 13.2bp, 1 年期国债收益率累计下行 12.7bp。

信用债方面, 上半年市场的信用风险偏好经历了先降后升, 3 月信用债异常成交因华夏幸福等的风险事件发酵而达到顶峰, 而随着 3-4 月信用债到期高峰的平稳度过, 以及地方政府的积极表态, 市场情绪逐步好转; 同时, 受房地产三条红线和城投发债“红橙黄绿”的多重限制, 上半年信用债供给缩量, 供需因而产生错配, 小型资产荒渐显, 二级市场信用债收益率整体逐步下行。

可转债方面, 上半年中证转债指数上涨 4.0%。分类型来看, 股性转债(转股价值大于 130 元)表现较好, 平均累计涨幅达到 50.8%; 中等市值券(100 亿至 300 亿)表现次好, 平均涨幅达到 15.3%。行业方面, 多数行业取得正收益, 其中成长板块表现尤为突出。

本基金债券部分上半年在严格控制风险的前提下, 以精选信用债配置策略为主。整体来看, 规避了信用风险, 获得了稳定较高收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内, 海富通富盈混合 A 份额净值增长率为 2.80%, 同期业绩比较基准收益率为 0.95%, 基金净值跑赢业绩比较基准 1.85 个百分点。海富通富盈混合 C 份额净值增长率为 2.60%, 同期业绩比较基准收益率为 0.95%, 基金净值跑赢业绩比较基准 1.65 个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

股票方面，展望下半年，经济复苏态势或依然延续，政策工具箱已经提前打开。经济韧性依旧，出口与地产投资扩张趋势或可延续。货币政策预期可能更加平稳，对整个市场的影响或弱于上半年。当然，信用风险事件可能还会持续发生，流动性条件或与上半年相仿。

不管是周期还是成长，上半年的主线就是业绩（分子端）。上游原材料价格压力下半年依然明显，上游盈利或依然强于中游。产业趋势变化将是权益市场的主要驱动力。经济结构变化带来的红利较为确定，电动车、半导体、光伏等受益于政策导向的行业投资机会，或更加容易把握。行业格局较为良好的周期板块或可享受业绩增长带来的收益。

债券方面，展望下半年，经济方面，制造业投资继续修复但速度或有所放缓，消费的修复在居民收入未得到改善的情况下不宜过度乐观，基建投资在地方债发行的配合下或稍有起色但仍偏慢。工业生产受到原材料价格上涨以及出口订单回落的影响或小幅走弱，地产投资方面受到“三道红线”监管的影响或略显低迷，销售端已有走弱的趋势。经济的不确定性或在于出口的回落。PMI 新出口订单已连续数月回落，并且连续两个月处于荣枯线以下，暗示出口份额的回落。通胀预期最强的阶段或已过去，后续传导继续不畅的情况下，核心 CPI 上行的速率较慢。流动性方面央行有意维护，7 月全面降准 0.5 个百分点，释放长期资金 1 万亿元，一方面置换到期的 MLF，另一方面也打消了未来流动性收紧的预期，但下半年仍有专项债集中发行的压力，对流动性或造成一定的负面影响。总体看，下半年国内经济恢复动能或延续走弱趋势，工业品通胀压力稍有缓解，流动性维持平稳宽松，在此背景下利率债收益率或有所下行。

信用债方面，经济整体修复，但融资分化的格局持续，信用挖掘的落脚点是融资环境是否确定和基本面能否向好。城投债方面，经济发达区域的城投平台债券的“抱团”需求仍会延续，传统弱区域和融资持续收紧地区城投平台可能面临较大的流动性压力。地产债方面，政策持续高压，企业分化加剧。资金实力雄厚的国企和龙头将获得融资和优质地块的加持，竞争力得到巩固，而债务负担重，仍有前期高价囤积地块待消化、流动性紧张的房企会面临诸多困难。此外，随着传统跟踪评级季节性高峰到来，需关注部分行业或个券评级的大幅调整对其估值的扰动，特别是财报出现恶化的产业债发行人以及财力较弱、融资持续流出的部分区域边缘平台。可转债方面，重点关注高景气度、高增速的确定性方向。

下半年，本基金债券部分配置以中高等级信用债为主。同时，积极关注利率债的交易性机会，并配合股票部分投资策略，做好流动性管理。

4.6 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。

4.7 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，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

4.8 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

本基金本报告期无需要说明的情形。

§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

本托管人依据《海富通富盈混合型证券投资基金基金合同》与《海富通富盈混合型证券投资基金托管协议》，自 2020 年 5 月 20 日起托管海富通富盈混合型证券投资基金（以下称本基金）的全部资产。

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本

基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：海富通富盈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 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 2,764,890.98 | 18,140,351.74 |
| 结算备付金 | | 11,251,586.57 | 20,020,214.91 |
| 存出保证金 | | 3,259,446.58 | 7,917,409.41 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 679,686,902.45 | 1,344,823,907.23 |
| 其中：股票投资 | | 163,521,528.29 | 338,744,596.47 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 516,165,374.16 | 1,006,079,310.76 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 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 | | 9,241,710.84 | 4,186,321.87 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 6,518,802.87 | 13,486,656.09 |
| 应收股利 | | 21,840.00 | - |
| 应收申购款 | | 60,792.05 | 638,301.35 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 712,805,972.34 | 1,409,213,162.60 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |

| | | | |
|---------------|----------|----------------|------------------|
| 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 | | 26,000,000.00 | 143,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | | - | 1.72 |
| 应付赎回款 | | 12,358,102.40 | 33,498,579.21 |
| 应付管理人报酬 | | 583,321.69 | 1,168,944.31 |
| 应付托管费 | | 145,830.37 | 292,236.05 |
| 应付销售服务费 | | 155,792.99 | 262,121.93 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 57,838.69 | 192,739.46 |
| 应交税费 | | 54,599.19 | 100,475.58 |
| 应付利息 | | 588.50 | -50,630.14 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 91,743.00 | 150,384.69 |
| 负债合计 | | 39,447,816.83 | 178,614,852.81 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 622,542,266.91 | 1,167,783,074.29 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 50,815,888.60 | 62,815,235.50 |
| 所有者权益合计 | | 673,358,155.51 | 1,230,598,309.79 |
| 负债和所有者权益总计 | | 712,805,972.34 | 1,409,213,162.60 |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 622,542,266.91 份。其中海富通富盈混合 A 基金份额总额 201,740,435.76 份，份额净值 1.0849 元，海富通富盈混合 C 基金份额总额 420,801,831.15 份，份额净值 1.0801 元。

6.2 利润表

会计主体：海富通富盈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 5 月 20 日（基 金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日 |
|-------------|----------|--|---|
| 一、收入 | | 36,415,097.32 | 12,606,116.42 |
| 1.利息收入 | | 10,547,168.06 | 6,992,612.49 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 145,447.61 | 785,056.98 |
| 债券利息收入 | | 10,372,546.46 | 4,699,290.44 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 29,173.99 | 1,508,265.07 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |

| | | | |
|----------------------------|----------|----------------------|---------------------|
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 41,593,345.10 | 2,623,137.09 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 52,170,138.09 | 120,321.57 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -2,404,280.61 | -78,916.97 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | -9,325,795.87 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 1,153,283.49 | 2,581,732.49 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -15,759,527.17 | 2,990,366.84 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 34,111.33 | - |
| 减：二、费用 | | 8,020,726.14 | 5,155,942.93 |
| 1. 管理人报酬 | | 4,278,411.27 | 3,286,495.74 |
| 2. 托管费 | | 1,069,602.68 | 821,623.90 |
| 3. 销售服务费 | | 1,048,518.47 | 824,709.78 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 502,451.27 | 171,441.76 |
| 5. 利息支出 | | 965,076.36 | 7,571.28 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 965,076.36 | 7,571.28 |
| 6.税金及附加 | | 32,734.91 | 12,107.65 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 123,931.18 | 31,992.82 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 28,394,371.18 | 7,450,173.49 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 28,394,371.18 | 7,450,173.49 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通富盈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） | 1,167,783,074.29 | 62,815,235.50 | 1,230,598,309.79 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 28,394,371.18 | 28,394,371.18 |
| 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） | -545,240,807.38 | -40,393,718.08 | -585,634,525.46 |
| 其中：1.基金申购款 | 177,666,447.48 | 12,802,065.44 | 190,468,512.92 |

| | | | |
|--|---|----------------|------------------|
| 2.基金赎回款 | -722,907,254.86 | -53,195,783.52 | -776,103,038.38 |
| 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） | 622,542,266.91 | 50,815,888.60 | 673,358,155.51 |
| 项目 | 上年度可比期间 2020年5月20日（基金合同生效日）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） | 2,931,943,904.52 | - | 2,931,943,904.52 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 7,450,173.49 | 7,450,173.49 |
| 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） | - | - | - |
| 其中：1.基金申购款 | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - |
| 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） | 2,931,943,904.52 | 7,450,173.49 | 2,939,394,078.01 |

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

海富通富盈混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]332号《关于准予海富通富盈混合型证券投资基金注册的批复》注册，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《海富通富盈混合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2,931,336,195.26元，其中海富通富盈混合A为人民币1,092,228,123.51元，海富通富盈混合C为人民币1,839,108,071.75元。经向中国证监会备案，《海富通富盈混合型证券投

资基金基金合同》于 2020 年 5 月 20 日正式生效，基金合同生效日的海富通富盈混合 A 基金份额总额为 1,092,446,802.70 份，其中认购资金利息折合 218,679.19 份基金份额，海富通富盈混合 C 基金份额总额为 1,839,497,101.82 份，其中认购资金利息折合 389,030.07 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《海富通富盈混合型证券投资基金基金合同》和《海富通富盈混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通富盈混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、港股通标的股票、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可交换债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、股指期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产及存托凭证的比例占基金资产的比例为 0%-40%，投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0-50%，投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%；每个交易日日终，扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券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。本基金业绩比较基准为：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%。

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

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况、2021 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

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 [2012] 85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2014] 81 号文《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税 [2016] 127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 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。

(b) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金个人所得应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(e) 本基金城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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 | 2,764,890.98 |
| 定期存款 | - | |
| 其他存款 | - | |
| 合计 | 2,764,890.98 | |

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 | 130,529,642.01 | 163,521,528.29 | 32,991,886.28 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 297,139,216.69 | 294,851,374.16 | -2,287,842.53 |
| 交易所市场 | | | |

| | | | | |
|--------|-------|----------------|----------------|---------------|
| | 银行间市场 | 222,762,335.03 | 221,314,000.00 | -1,448,335.03 |
| | 合计 | 519,901,551.72 | 516,165,374.16 | -3,736,177.56 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 650,431,193.73 | 679,686,902.45 | 29,255,708.72 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 | | | |
|--------|-------------------|------|----|----|
| | 合同/名义 金额 | 公允价值 | | 备注 |
| | | 资产 | 负债 | |
| 利率衍生工具 | - | - | - | - |
| 货币衍生工具 | - | - | - | - |
| 权益衍生工具 | -24,849,300.00 | - | - | - |
| ——股指期货 | -24,849,300.00 | - | - | - |
| 其他衍生工具 | - | - | - | - |
| 合计 | -24,849,300.00 | - | - | - |

注：1、于2021年6月30日，本基金持有的股指期货情况：持有卖出IF2109合约市值-26,348,640.00元，公允价值变动-1,499,340.00元；公允价值变动合计-1,499,340.00元。

2、按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

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

本基金于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

本基金于本报告期末未持有从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 | 968.06 |
| 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 | 22,455.61 |
| 应收债券利息 | 6,495,335.30 |
| 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 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 应收出借证券利息 | - |
| 其他 | 43.90 |
| 合计 | 6,518,802.87 |

6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 56,856.64 |
| 银行间市场应付交易费用 | 982.05 |
| 合计 | 57,838.69 |

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 | 3.15 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 91,739.85 |
| 合计 | 91,743.00 |

6.4.7.9 实收基金

海富通富盈混合 A

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 | 账面金额 |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末 | 508,304,749.87 | 508,304,749.87 |
| 本期申购 | 21,080,321.01 | 21,080,321.01 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -327,644,635.12 | -327,644,635.12 |
| 本期末 | 201,740,435.76 | 201,740,435.76 |

海富通富盈混合 C

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 | 账面金额 |
| 上年度末 | 659,478,324.42 | 659,478,324.42 |
| 本期申购 | 156,586,126.47 | 156,586,126.47 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -395,262,619.74 | -395,262,619.74 |
| 本期末 | 420,801,831.15 | 420,801,831.15 |

注：此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

海富通富盈混合 A

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 | 15,361,223.45 | 12,730,544.41 | 28,091,767.86 |
| 本期利润 | 17,085,261.38 | -4,741,503.87 | 12,343,757.51 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -14,426,928.08 | -8,880,385.04 | -23,307,313.12 |
| 其中：基金申购款 | 1,104,825.28 | 407,940.68 | 1,512,765.96 |
| 基金赎回款 | -15,531,753.36 | -9,288,325.72 | -24,820,079.08 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 18,019,556.75 | -891,344.50 | 17,128,212.25 |

海富通富盈混合 C

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 | 18,238,971.28 | 16,484,496.36 | 34,723,467.64 |
| 本期利润 | 27,068,636.97 | -11,018,023.30 | 16,050,613.67 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -9,790,702.20 | -7,295,702.76 | -17,086,404.96 |
| 其中：基金申购款 | 6,989,133.58 | 4,300,165.90 | 11,289,299.48 |

| | | | |
|---------|----------------|----------------|----------------|
| 基金赎回款 | -16,779,835.78 | -11,595,868.66 | -28,375,704.44 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 35,516,906.05 | -1,829,229.70 | 33,687,676.35 |

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 | | 21,922.53 |
| 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 | | 113,992.95 |
| 其他 | | 9,532.13 |
| 合计 | | 145,447.61 |

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 | | 239,400,579.43 |
| 减：卖出股票成本总额 | | 187,230,441.34 |
| 买卖股票差价收入 | | 52,170,138.09 |

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|------------------------|----------------------|----------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | | 554,651,167.43 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | | 547,733,375.43 |
| 减：应收利息总额 | | 9,322,072.61 |
| 买卖债券差价收入 | | -2,404,280.61 |

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|
| 股指期货投资收益（税前） | -9,325,795.87 |
| 股指期货差价收入应缴纳增值税额 | - |
| 合计 | -9,325,795.87 |

6.4.7.16 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 | 1,153,283.49 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 1,153,283.49 |

6.4.7.17 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 | -22,286,323.04 |
| ——股票投资 | -29,345,363.81 |
| ——债券投资 | 7,059,040.77 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2.衍生工具 | 6,526,795.87 |
| ——权证投资 | - |
| ——股指期货 | 6,526,795.87 |
| 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 | -15,759,527.17 |

6.4.7.18 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 | 34,036.79 |
| 基金补差费收入 | 74.54 |
| 合计 | 34,111.33 |

6.4.7.19 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 | 499,926.27 |
| 银行间市场交易费用 | 2,525.00 |
| 合计 | 502,451.27 |

6.4.7.20 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 | 32,232.48 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 证券组合费 | 199.30 |
| 银行划款手续费 | 13,892.03 |
| 其他费用 | 600.00 |
| 债券托管账户维护费 | 17,100.00 |
| 开户费 | 400.00 |
| 合计 | 123,931.18 |

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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、注册登记机构、基金销售 |

| | |
|--------------------|-----------------|
| | 机构 |
| 兴业银行股份有限公司(“兴业银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| 海通证券股份有限公司(“海通证券”) | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

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5月20日（基金合同生效日） 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 |
| 海通证券 | 271,767,779.63 | 100.00% | 190,936,805.41 | 100.00% |

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

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 |
| 海通证券 | 197,098.84 | 100.00% | 56,856.64 | 100.00% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2020年5月20日（基金合同生效日）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 |
| 海通证券 | 138,238.55 | 100.00% | 138,238.55 | 100.00% |

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用海通证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从海通证券获得研究综合服务。

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 | 上年度可比期间 |
|-----------------|----------------------|--------------------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 | 2020年5月20日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 4,278,411.27 | 3,286,495.74 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,655,744.36 | 1,559,633.51 |

注：支付基金管理人海富通基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|--------------------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 | 2020年5月20日（基金合同生效日）至2020年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,069,602.68 | 821,623.90 |

注：支付基金托管人兴业银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|----------------|--------------------------------|--------------|--------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 海富通富盈混合 A | 海富通富盈混合 C | 合计 |
| 兴业银行 | - | 713,318.51 | 713,318.51 |
| 海通证券 | - | 2,180.75 | 2,180.75 |
| 海富通基金 | - | 313,124.14 | 313,124.14 |
| 合计 | - | 1,028,623.40 | 1,028,623.40 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 2020年5月20日（基金合同生效日）至2020年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 海富通富盈混合A | 海富通富盈混合C | 合计 |
| 兴业银行 | - | 771,580.18 | 771,580.18 |
| 海通证券 | - | 1,921.59 | 1,921.59 |
| 海富通基金 | - | 29,365.22 | 29,365.22 |

| | | | |
|----|---|------------|------------|
| 合计 | - | 802,866.99 | 802,866.99 |
|----|---|------------|------------|

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：海富通富盈混合 C 类基金日基金销售服务费=前一日 C 类份额对应的基金资产净值 × 0.40% / 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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行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

本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间均未持有过本基金。

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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

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 2021年1月1日至2021年6月30日 | | 上年度可比期间 2020年5月20日（基金合同生效 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 |
| 兴业银行 | 2,764,890.98 | 21,922.53 | 31,792,543.27 | 236,203.28 |

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | | | | | |
|--|--------|------|------|----------------|------------|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位： 股/张） | 总金额 |
| 海通证券 | 300933 | 中辰股份 | 网下发行 | 11,117 | 37,464.29 |
| 海通证券 | 688680 | 海优新材 | 网下发行 | 2,795 | 195,482.30 |
| 海通证券 | 688687 | 凯因科技 | 网下发行 | 5,354 | 101,618.92 |
| 海通证券 | 688665 | 四方光电 | 网下发行 | 1,687 | 49,817.11 |
| 海通证券 | 688092 | 爱科科技 | 网下发行 | 1,137 | 21,728.07 |
| 海通证券 | 688626 | 翔宇医疗 | 网下发行 | 3,652 | 105,250.64 |
| 海通证券 | 688630 | 芯碁微装 | 网下发行 | 3,397 | 51,736.31 |
| 海通证券 | 688682 | 霍莱沃 | 网下发行 | 946 | 43,251.12 |
| 海通证券 | 300981 | 中红医疗 | 网下发行 | 6,003 | 291,685.77 |
| 海通证券 | 688217 | 睿昂基因 | 网下发行 | 1,040 | 19,156.80 |
| 上年度可比期间 2020 年 5 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日 | | | | | |
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位： 股/张） | 总金额 |
| - | - | - | - | - | - |

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

本基金于本报告期内及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金在本报告期内未进行过利润分配。

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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|------------|--------|-------|--------|----------|------------|------------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 300702 | 天宇股份 | 2021-01-18 | 2021-07-20 | 非公开定增 | 80.95 | 34.49 | 22,235 | 999,975.35 | 766,885.15 | - |
| 300919 | 中伟股份 | 2020-12-15 | 2021-07-02 | 新股锁定 | 24.60 | 163.00 | 610 | 15,006.00 | 99,430.00 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------------|----------|-------|-------|-------|----------|-----------|---|
| | | | | 流通受限 | | | | | | |
| 300927 | 江天化学 | 2020-12-29 | 2021-07-07 | 新股锁定流通受限 | 13.39 | 30.10 | 217 | 2,905.63 | 6,531.70 | - |
| 300929 | 华骐环保 | 2021-01-12 | 2021-07-21 | 新股锁定流通受限 | 13.87 | 29.55 | 183 | 2,538.21 | 5,407.65 | - |
| 300930 | 屹通新材 | 2021-01-13 | 2021-07-21 | 新股锁定流通受限 | 13.11 | 24.48 | 322 | 4,221.42 | 7,882.56 | - |
| 300931 | 通用电梯 | 2021-01-13 | 2021-07-21 | 新股锁定流通受限 | 4.31 | 13.11 | 672 | 2,896.32 | 8,809.92 | - |
| 300933 | 中辰股份 | 2021-01-15 | 2021-07-22 | 新股锁定流通受限 | 3.37 | 10.44 | 1,112 | 3,747.44 | 11,609.28 | - |
| 300937 | 药易购 | 2021-01-20 | 2021-07-27 | 新股锁定流通受限 | 12.25 | 53.71 | 244 | 2,989.00 | 13,105.24 | - |
| 300942 | 易瑞生物 | 2021-02-02 | 2021-08-09 | 新股锁定流通受限 | 5.31 | 28.52 | 443 | 2,352.33 | 12,634.36 | - |
| 300943 | 春晖智控 | 2021-02-03 | 2021-08-10 | 新股锁定流通受限 | 9.79 | 23.01 | 255 | 2,496.45 | 5,867.55 | - |
| 300945 | 曼卡龙 | 2021-02-03 | 2021-08-10 | 新股锁定流通受限 | 4.56 | 18.88 | 474 | 2,161.44 | 8,949.12 | - |
| 300948 | 冠中生态 | 2021-02-18 | 2021-08-25 | 新股锁定流通受限 | 13.00 | 27.42 | 324 | 2,808.00 | 8,884.08 | - |
| 300950 | 德固特 | 2021-02-24 | 2021-09-03 | 新股锁定流通 | 8.41 | 39.13 | 219 | 1,841.79 | 8,569.47 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------------|----------|-------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| | | | | 受限 | | | | | | |
| 300952 | 恒辉安防 | 2021-03-03 | 2021-09-13 | 新股锁定流通受限 | 11.72 | 27.08 | 340 | 3,984.80 | 9,207.20 | - |
| 300955 | 嘉亨家化 | 2021-03-16 | 2021-09-24 | 新股锁定流通受限 | 16.53 | 46.07 | 232 | 3,834.96 | 10,688.24 | - |
| 300956 | 英力股份 | 2021-03-16 | 2021-09-27 | 新股锁定流通受限 | 12.85 | 25.80 | 371 | 4,767.35 | 9,571.80 | - |
| 300958 | 建工修复 | 2021-03-18 | 2021-09-29 | 新股锁定流通受限 | 8.53 | 27.22 | 300 | 2,559.00 | 8,166.00 | - |
| 300960 | 通业科技 | 2021-03-22 | 2021-09-29 | 新股锁定流通受限 | 12.08 | 23.06 | 234 | 2,826.72 | 5,396.04 | - |
| 300962 | 中金辐照 | 2021-03-29 | 2021-10-11 | 新股锁定流通受限 | 3.40 | 16.37 | 576 | 1,958.40 | 9,429.12 | - |
| 300963 | 中洲特材 | 2021-03-30 | 2021-10-11 | 新股锁定流通受限 | 12.13 | 22.49 | 283 | 3,432.79 | 6,364.67 | - |
| 300967 | 晓鸣股份 | 2021-04-02 | 2021-10-13 | 新股锁定流通受限 | 4.54 | 11.54 | 507 | 2,301.78 | 5,850.78 | - |
| 300968 | 格林精密 | 2021-04-06 | 2021-10-15 | 新股锁定流通受限 | 6.87 | 12.07 | 1,162 | 7,982.94 | 14,025.34 | - |
| 300973 | 立高食品 | 2021-04-08 | 2021-10-15 | 新股锁定流通受限 | 28.28 | 115.71 | 360 | 10,180.80 | 41,655.60 | - |
| 300975 | 商络电子 | 2021-04-14 | 2021-10-21 | 新股锁定流通受限 | 5.48 | 13.03 | 492 | 2,696.16 | 6,410.76 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------------|----------------------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| 300981 | 中红医疗 | 2021-04-19 | 2021-10-27 | 新股 锁定 流通 受限 | 48.59 | 90.39 | 601 | 29,202.59 | 54,324.39 | - |
| 300985 | 致远新能 | 2021-04-21 | 2021-10-29 | 新股 锁定 流通 受限 | 24.90 | 24.81 | 295 | 7,345.50 | 7,318.95 | - |
| 300986 | 志特新材 | 2021-04-21 | 2021-11-01 | 新股 锁定 流通 受限 | 14.79 | 30.57 | 264 | 3,904.56 | 8,070.48 | - |
| 300987 | 川网传媒 | 2021-04-28 | 2021-11-11 | 新股 锁定 流通 受限 | 6.79 | 26.81 | 301 | 2,043.79 | 8,069.81 | - |
| 300991 | 创益通 | 2021-05-12 | 2021-11-22 | 新股 锁定 流通 受限 | 13.06 | 26.51 | 254 | 3,317.24 | 6,733.54 | - |
| 300993 | 玉马遮阳 | 2021-05-17 | 2021-11-24 | 新股 锁定 流通 受限 | 12.10 | 19.29 | 410 | 4,961.00 | 7,908.90 | - |
| 300995 | 奇德新材 | 2021-05-17 | 2021-11-26 | 新股 锁定 流通 受限 | 14.72 | 23.32 | 191 | 2,811.52 | 4,454.12 | - |
| 300996 | 普联软件 | 2021-05-26 | 2021-12-03 | 新股 锁定 流通 受限 | 20.81 | 42.23 | 241 | 5,015.21 | 10,177.43 | - |
| 300997 | 欢乐家 | 2021-05-26 | 2021-12-02 | 新股 锁定 流通 受限 | 4.94 | 13.05 | 928 | 4,584.32 | 12,110.40 | - |
| 300998 | 宁波方正 | 2021-05-25 | 2021-12-02 | 新股 锁定 流通 受限 | 6.02 | 21.32 | 201 | 1,210.02 | 4,285.32 | - |
| 301009 | 可靠股份 | 2021-06-08 | 2021-12-17 | 新股 锁定 流通 受限 | 12.54 | 27.89 | 801 | 10,044.54 | 22,339.89 | - |
| 301011 | 晶雪 | 2021-0 | 2021-1 | 新股 | 7.83 | 17.61 | 218 | 1,706. | 3,838. | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|----------|----------------|----------------|----------------------|-------|--------|-------|----------------|----------------|---|
| 0 | 节能 | 6-09 | 2-20 | 锁定 流通 受限 | | | | 94 | 98 | |
| 30101 5 | 百洋 医药 | 2021-0 6-22 | 2021-1 2-30 | 新股 锁定 流通 受限 | 7.64 | 38.83 | 462 | 3,529. 68 | 17,939 .46 | - |
| 30101 6 | 雷尔 伟 | 2021-0 6-23 | 2021-1 2-30 | 新股 锁定 流通 受限 | 13.75 | 32.98 | 275 | 3,781. 25 | 9,069. 50 | - |
| 30101 8 | 申菱 环境 | 2021-0 6-28 | 2021-0 7-07 | 新股 未上 市 | 8.29 | 8.29 | 7,029 | 58,270 .41 | 58,270 .41 | - |
| 30101 8 | 申菱 环境 | 2021-0 6-28 | 2022-0 1-07 | 新股 锁定 流通 受限 | 8.29 | 8.29 | 782 | 6,482. 78 | 6,482. 78 | - |
| 30102 1 | 英诺 激光 | 2021-0 6-28 | 2021-0 7-06 | 新股 未上 市 | 9.46 | 9.46 | 2,609 | 24,681 .14 | 24,681 .14 | - |
| 30102 1 | 英诺 激光 | 2021-0 6-28 | 2022-0 1-06 | 新股 锁定 流通 受限 | 9.46 | 9.46 | 290 | 2,743. 40 | 2,743. 40 | - |
| 60516 2 | 新中 港 | 2021-0 6-29 | 2021-0 7-07 | 新股 未上 市 | 6.07 | 6.07 | 1,377 | 8,358. 39 | 8,358. 39 | - |
| 60528 7 | 德才 股份 | 2021-0 6-28 | 2021-0 7-06 | 新股 未上 市 | 31.56 | 31.56 | 349 | 11,014 .44 | 11,014 .44 | - |
| 68808 7 | 英科 再生 | 2021-0 6-30 | 2021-0 7-09 | 新股 未上 市 | 21.96 | 21.96 | 2,469 | 54,219 .24 | 54,219 .24 | - |
| 68813 1 | 皓元 医药 | 2021-0 6-01 | 2021-1 2-08 | 新股 锁定 流通 受限 | 64.99 | 247.10 | 1,955 | 127,05 5.45 | 483,08 0.50 | - |
| 68822 6 | 威腾 电气 | 2021-0 6-28 | 2021-0 7-07 | 新股 未上 市 | 6.42 | 6.42 | 2,693 | 17,289 .06 | 17,289 .06 | - |
| 68826 0 | 昀冢 科技 | 2021-0 3-25 | 2021-1 0-08 | 新股 锁定 流通 受限 | 9.63 | 16.41 | 2,990 | 28,793 .70 | 49,065 .90 | - |

| 688276 | 百克生物 | 2021-06-17 | 2021-12-27 | 新股锁定流通受限 | 36.35 | 79.48 | 3,486 | 126,716.10 | 277,067.28 | - |
|-----------------------------|------|------------|------------|----------|--------|--------|----------|------------|--------------|----|
| 688323 | 瑞华泰 | 2021-04-21 | 2021-10-28 | 新股锁定流通受限 | 5.97 | 22.78 | 4,513 | 26,942.61 | 102,806.14 | - |
| 688425 | 铁建重工 | 2021-06-11 | 2021-12-22 | 新股锁定流通受限 | 2.87 | 4.75 | 111,008 | 318,592.96 | 527,288.00 | - |
| 688660 | 电气风电 | 2021-05-11 | 2021-11-19 | 新股锁定流通受限 | 5.44 | 7.26 | 46,934 | 255,320.96 | 340,740.84 | - |
| 688680 | 海优新材 | 2021-01-15 | 2021-07-22 | 新股锁定流通受限 | 69.94 | 243.61 | 2,795 | 195,482.30 | 680,889.95 | - |
| 688686 | 奥普特 | 2020-12-24 | 2021-07-01 | 新股锁定流通受限 | 78.49 | 451.00 | 2,330 | 182,881.70 | 1,050,830.00 | - |
| 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券 | | | | | | | | | | |
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位：张) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 123117 | 健帆转债 | 2021-06-23 | 2021-07-12 | 老股东配债 | 100.00 | 100.00 | 21 | 2,100.00 | 2,100.00 | - |

注：1、根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算，在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金持有的上市公司非公开发行股份，减持采取集中竞价交易方式或采取大宗交易方式的根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由法规规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

2、[300702]天宇股份于 2021 年 1 月 18 日非公开定增买入数量 12,353 股，成本 999,975.35 元；于 2021 年 6 月 18 日送股，数量 9,882 股。因此总数量 22,235 股，总成本 999,975.35 元。

3、[300948]冠中生态于 2021 年 2 月 18 日中签新股锁定流通受限数量 216 股，成本 2,808.00 元；于 2021 年 6 月 4 日送股，数量 108 股。因此总数量 324 股，总成本 2,808.00 元。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金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

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款总额 26,000,000.00 元，其中 23,000,000.00 元上海交易所正回购于 2021 年 7 月 1 日到期，3,000,000.00 元上海交易所正回购于 2021 年 7 月 5 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金，为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。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相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

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，将风险控制可在可承受的范围内。

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。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 69.20%。(2020 年 12 月 31 日：72.11%)。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2021年6月30日 | 上年末 2020年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |

| | | |
|-----|---|---------------|
| 未评级 | - | 69,747,000.00 |
| 合计 | - | 69,747,000.00 |

注：未评级债券为国债及政策性金融债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2021年6月30日 | 上年末 2020年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | - | 146,293,000.00 |
| 合计 | - | 146,293,000.00 |

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2021年6月30日 | 上年末 2020年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| AAA | 410,332,476.73 | 672,486,643.91 |
| AAA 以下 | 55,647,897.43 | 68,603,666.85 |
| 未评级 | 50,185,000.00 | 48,949,000.00 |
| 合计 | 516,165,374.16 | 790,039,310.76 |

注：未评级债券为国债及政策性金融债。

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，除卖出回购金融资产款余额中有人民币 26,000,000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约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期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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。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 0.74%。

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。

本基金持有及承担的大部分权益类金融资产和金融负债不计息，该部分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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种存在相应的利率风险，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。

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 | 2,764,890.98 | - | - | - | 2,764,890.98 |
| 结算备付金 | 11,251,586.57 | - | - | - | 11,251,586.57 |
| 存出保证金 | 97,609.78 | - | - | 3,161,836.80 | 3,259,446.58 |
| 交易性金融资产 | 182,168,378.00 | 331,309,144.68 | 2,687,851.48 | 163,521,528.29 | 679,686,902.45 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 9,241,710.84 | 9,241,710.84 |
| 应收利息 | - | - | - | 6,518,802.87 | 6,518,802.87 |
| 应收股利 | - | - | - | 21,840.00 | 21,840.00 |
| 应收申购款 | - | - | - | 60,792.05 | 60,792.05 |
| 资产总计 | 196,282,465.33 | 331,309,144.68 | 2,687,851.48 | 182,526,510.85 | 712,805,972.34 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 26,000,000.00 | - | - | - | 26,000,000.00 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 12,358,102.40 | 12,358,102.40 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 583,321.69 | 583,321.69 |
| 应付托管费 | - | - | - | 145,830.37 | 145,830.37 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 155,792.99 | 155,792.99 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 57,838.69 | 57,838.69 |
| 应交税费 | - | - | - | 54,599.19 | 54,599.19 |
| 应付利息 | - | - | - | 588.50 | 588.50 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|----------------|----------------|---------------|----------------|------------------|
| 其他负债 | - | - | - | 91,743.00 | 91,743.00 |
| 负债总计 | 26,000,000.00 | - | - | 13,447,816.83 | 39,447,816.83 |
| 利率敏感度缺口 | 170,282,465.33 | 331,309,144.68 | 2,687,851.48 | 169,078,694.02 | 673,358,155.51 |
| 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 | 18,140,351.74 | - | - | - | 18,140,351.74 |
| 结算备付金 | 20,020,214.91 | - | - | - | 20,020,214.91 |
| 存出保证金 | 7,917,409.41 | - | - | - | 7,917,409.41 |
| 交易性金融资产 | 328,901,440.00 | 632,204,423.47 | 44,973,447.29 | 338,744,596.47 | 1,344,823,907.23 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 4,186,321.87 | 4,186,321.87 |
| 应收利息 | - | - | - | 13,486,656.09 | 13,486,656.09 |
| 应收申购款 | - | - | - | 638,301.35 | 638,301.35 |
| 资产总计 | 374,979,416.06 | 632,204,423.47 | 44,973,447.29 | 357,055,875.78 | 1,409,213,162.60 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 143,000,000.00 | - | - | - | 143,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 1.72 | 1.72 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 33,498,579.21 | 33,498,579.21 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,168,944.31 | 1,168,944.31 |
| 应付托管费 | - | - | - | 292,236.05 | 292,236.05 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 192,739.46 | 192,739.46 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 262,121.93 | 262,121.93 |
| 应付利息 | - | - | - | -50,630.14 | -50,630.14 |
| 应交税费 | - | - | - | 100,475.58 | 100,475.58 |
| 其他负债 | - | - | - | 150,384.69 | 150,384.69 |
| 负债总计 | 143,000,000.00 | - | - | 35,614,852.81 | 178,614,852.81 |
| 利率敏感度缺口 | 231,979,416.06 | 632,204,423.47 | 44,973,447.29 | 321,441,022.97 | 1,230,598,309.79 |

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

| 假设 | 除市场利率以外的其他变量保持不变 | | |
|----|------------------|----------------|---------------|
| 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 | 上年度末 |
| | | 2021年6月30日 | 2020年12月31日 |
| | 市场利率上升 25 个基点 | -1,968,264.71 | -4,618,379.30 |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 1,984,717.07 | 4,670,530.59 |

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 | 合计 |
| 以外币计价的 资产 | | | |
| 资产合计 | - | 7,381,084.20 | 7,381,084.20 |
| 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 | - | 7,381,084.20 | 7,381,084.20 |

| 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 | 合计 |
| 以外币计价的 资产 | | | |
| 资产合计 | - | 4,067,275.80 | 4,067,275.80 |
| 以外币计价的 负债 | | | |
| 负债合计 | - | 1.72 | 1.72 |
| 资产负债表外 汇风险敞口净 额 | - | 4,067,274.08 | 4,067,274.08 |

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% | | 369,054.21 |
| 2. 所有外币相对人民币贬值 5% | | -369,054.21 | -203,363.70 |

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和债券，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，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。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 | 163,521,528.29 | 24.28 | 338,744,596.47 | 27.53 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 163,521,528.29 | 24.28 | 338,744,596.47 | 27.53 |

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(附注 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% | 6,949,663.22 | 14,129,083.62 |
| | 2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5% | -6,949,663.22 | -14,129,083.62 |

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，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 | 163,521,528.29 | 22.94 |
| | 其中：股票 | 163,521,528.29 | 22.94 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 516,165,374.16 | 72.41 |
| | 其中：债券 | 516,165,374.16 | 72.41 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 14,016,477.55 | 1.97 |
| 8 | 其他各项资产 | 19,102,592.34 | 2.68 |
| 9 | 合计 | 712,805,972.34 | 100.00 |

注：本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 6,764,223.79 元，占资产净值比例为 1.00%；通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 595,020.41 元，占资产净值比例为 0.09%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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 | 125,057.98 | 0.02 |
| B | 采矿业 | 5,099,126.00 | 0.76 |
| C | 制造业 | 115,247,801.76 | 17.12 |

| | | | |
|---|------------------|----------------|-------|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,727,274.39 | 0.55 |
| E | 建筑业 | 11,014.44 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 1,152,634.13 | 0.17 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,733,759.60 | 0.41 |
| J | 金融业 | 22,152,038.90 | 3.29 |
| K | 房地产业 | 2,304,865.50 | 0.34 |
| L | 租赁和商务服务业 | 832,219.00 | 0.12 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,515,243.22 | 0.23 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 52,963.73 | 0.01 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 929,265.44 | 0.14 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 279,020.00 | 0.04 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 156,162,284.09 | 23.19 |

7.2.2 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（%） |
|----------|--------------|--------------|
| 原材料 | 330,502.18 | 0.05 |
| 非日常生活消费品 | 317,837.92 | 0.05 |
| 日常消费品 | 139,123.78 | 0.02 |
| 金融 | 452,152.27 | 0.07 |
| 信息技术 | 300,996.62 | 0.04 |
| 通信服务 | 5,818,631.43 | 0.86 |
| 合计 | 7,359,244.20 | 1.09 |

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 137,100 | 7,429,449.00 | 1.10 |
| 2 | 00700 | 腾讯控股 | 11,600 | 5,636,842.75 | 0.84 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 2,700 | 5,553,090.00 | 0.82 |
| 4 | 002415 | 海康威视 | 74,900 | 4,831,050.00 | 0.72 |
| 5 | 002142 | 宁波银行 | 116,300 | 4,532,211.00 | 0.67 |
| 6 | 600031 | 三一重工 | 154,900 | 4,502,943.00 | 0.67 |
| 7 | 000858 | 五粮液 | 13,700 | 4,081,093.00 | 0.61 |
| 8 | 002311 | 海大集团 | 48,200 | 3,933,120.00 | 0.58 |
| 9 | 601012 | 隆基股份 | 44,150 | 3,922,286.00 | 0.58 |
| 10 | 000001 | 平安银行 | 162,200 | 3,668,964.00 | 0.54 |
| 11 | 002332 | 仙琚制药 | 291,538 | 3,655,886.52 | 0.54 |
| 12 | 000568 | 泸州老窖 | 14,600 | 3,444,724.00 | 0.51 |
| 13 | 601966 | 玲珑轮胎 | 77,942 | 3,409,183.08 | 0.51 |
| 14 | 600887 | 伊利股份 | 88,900 | 3,274,187.00 | 0.49 |
| 15 | 600438 | 通威股份 | 74,300 | 3,214,961.00 | 0.48 |
| 16 | 000661 | 长春高新 | 8,300 | 3,212,100.00 | 0.48 |
| 17 | 600309 | 万华化学 | 29,415 | 3,200,940.30 | 0.48 |
| 18 | 000333 | 美的集团 | 42,500 | 3,033,225.00 | 0.45 |
| 19 | 600690 | 海尔智家 | 115,400 | 2,990,014.00 | 0.44 |
| 20 | 600900 | 长江电力 | 131,800 | 2,720,352.00 | 0.40 |
| 21 | 601318 | 中国平安 | 41,700 | 2,680,476.00 | 0.40 |
| 22 | 300760 | 迈瑞医疗 | 5,100 | 2,448,255.00 | 0.36 |
| 23 | 601225 | 陕西煤业 | 206,000 | 2,441,100.00 | 0.36 |
| 24 | 300014 | 亿纬锂能 | 23,117 | 2,402,549.81 | 0.36 |
| 25 | 300059 | 东方财富 | 68,520 | 2,246,770.80 | 0.33 |
| 26 | 002475 | 立讯精密 | 48,618 | 2,236,428.00 | 0.33 |
| 27 | 002271 | 东方雨虹 | 36,600 | 2,024,712.00 | 0.30 |
| 28 | 600276 | 恒瑞医药 | 27,240 | 1,851,502.80 | 0.27 |
| 29 | 000739 | 普洛药业 | 61,100 | 1,796,340.00 | 0.27 |
| 30 | 600741 | 华域汽车 | 67,400 | 1,770,598.00 | 0.26 |
| 31 | 000338 | 潍柴动力 | 98,000 | 1,751,260.00 | 0.26 |
| 32 | 600563 | 法拉电子 | 11,000 | 1,741,960.00 | 0.26 |
| 33 | 300316 | 晶盛机电 | 34,407 | 1,737,553.50 | 0.26 |
| 34 | 002008 | 大族激光 | 37,600 | 1,518,664.00 | 0.23 |
| 35 | 601088 | 中国神华 | 76,300 | 1,489,376.00 | 0.22 |
| 36 | 600176 | 中国巨石 | 91,783 | 1,423,554.33 | 0.21 |
| 37 | 300122 | 智飞生物 | 7,200 | 1,344,456.00 | 0.20 |
| 38 | 601877 | 正泰电器 | 38,000 | 1,268,440.00 | 0.19 |
| 39 | 002557 | 洽洽食品 | 28,258 | 1,217,919.80 | 0.18 |
| 40 | 603678 | 火炬电子 | 16,900 | 1,140,750.00 | 0.17 |
| 41 | 002444 | 巨星科技 | 32,900 | 1,121,232.00 | 0.17 |
| 42 | 600406 | 国电南瑞 | 45,360 | 1,054,166.40 | 0.16 |
| 43 | 688686 | 奥普特 | 2,330 | 1,050,830.00 | 0.16 |
| 44 | 000513 | 丽珠集团 | 21,000 | 1,050,420.00 | 0.16 |
| 45 | 600803 | 新奥股份 | 60,200 | 993,902.00 | 0.15 |
| 46 | 002493 | 荣盛石化 | 55,800 | 963,666.00 | 0.14 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|---------|------------|------|
| 47 | 601398 | 工商银行 | 184,500 | 953,865.00 | 0.14 |
| 48 | 002727 | 一心堂 | 27,900 | 923,769.00 | 0.14 |
| 49 | 603259 | 药明康德 | 5,808 | 909,474.72 | 0.14 |
| 50 | 000651 | 格力电器 | 16,800 | 875,280.00 | 0.13 |
| 51 | 002430 | 杭氧股份 | 24,400 | 843,996.00 | 0.13 |
| 52 | 000581 | 威孚高科 | 38,906 | 810,411.98 | 0.12 |
| 53 | 000002 | 万科A | 33,900 | 807,159.00 | 0.12 |
| 54 | 300037 | 新宙邦 | 7,800 | 780,780.00 | 0.12 |
| 55 | 300702 | 天宇股份 | 22,235 | 766,885.15 | 0.11 |
| 56 | 601899 | 紫金矿业 | 78,800 | 763,572.00 | 0.11 |
| 57 | 603501 | 韦尔股份 | 2,300 | 740,600.00 | 0.11 |
| 58 | 002001 | 新和成 | 25,320 | 726,177.60 | 0.11 |
| 59 | 600989 | 宝丰能源 | 53,000 | 725,040.00 | 0.11 |
| 60 | 601888 | 中国中免 | 2,400 | 720,240.00 | 0.11 |
| 61 | 688680 | 海优新材 | 2,795 | 680,889.95 | 0.10 |
| 62 | 600570 | 恒生电子 | 7,100 | 662,075.00 | 0.10 |
| 63 | 300408 | 三环集团 | 15,600 | 661,752.00 | 0.10 |
| 64 | 002241 | 歌尔股份 | 14,700 | 628,278.00 | 0.09 |
| 65 | 002258 | 利尔化学 | 24,300 | 626,940.00 | 0.09 |
| 66 | 600486 | 扬农化工 | 5,600 | 625,912.00 | 0.09 |
| 67 | 601636 | 旗滨集团 | 33,200 | 616,192.00 | 0.09 |
| 68 | 600383 | 金地集团 | 59,200 | 606,208.00 | 0.09 |
| 69 | 000656 | 金科股份 | 102,600 | 594,054.00 | 0.09 |
| 70 | 601288 | 农业银行 | 183,400 | 555,702.00 | 0.08 |
| 71 | 000786 | 北新建材 | 13,700 | 537,725.00 | 0.08 |
| 72 | 600809 | 山西汾酒 | 1,200 | 537,600.00 | 0.08 |
| 73 | 688425 | 铁建重工 | 111,008 | 527,288.00 | 0.08 |
| 74 | 300454 | 深信服 | 1,900 | 493,012.00 | 0.07 |
| 75 | 600521 | 华海药业 | 23,240 | 485,251.20 | 0.07 |
| 76 | 688131 | 皓元医药 | 1,955 | 483,080.50 | 0.07 |
| 77 | 603218 | 日月股份 | 17,451 | 472,573.08 | 0.07 |
| 78 | 603882 | 金域医学 | 2,900 | 463,333.00 | 0.07 |
| 79 | 000100 | TCL 科技 | 59,800 | 457,470.00 | 0.07 |
| 80 | 03908 | 中金公司 | 26,000 | 452,152.27 | 0.07 |
| 81 | 000538 | 云南白药 | 3,900 | 451,308.00 | 0.07 |
| 82 | 600885 | 宏发股份 | 7,100 | 445,170.00 | 0.07 |
| 83 | 600426 | 华鲁恒升 | 13,780 | 426,491.00 | 0.06 |
| 84 | 603987 | 康德莱 | 15,900 | 413,400.00 | 0.06 |
| 85 | 002541 | 鸿路钢构 | 6,600 | 385,110.00 | 0.06 |
| 86 | 600298 | 安琪酵母 | 6,300 | 342,594.00 | 0.05 |
| 87 | 688660 | 电气风电 | 46,934 | 340,740.84 | 0.05 |
| 88 | 000830 | 鲁西化工 | 18,100 | 339,013.00 | 0.05 |
| 89 | 00826 | 天工国际 | 120,000 | 330,502.18 | 0.05 |
| 90 | 300750 | 宁德时代 | 600 | 320,880.00 | 0.05 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|---------|------------|------|
| 91 | 601799 | 星宇股份 | 1,400 | 316,008.00 | 0.05 |
| 92 | 300244 | 迪安诊断 | 8,200 | 314,060.00 | 0.05 |
| 93 | 300639 | 凯普生物 | 9,135 | 301,546.35 | 0.04 |
| 94 | 300114 | 中航电测 | 19,800 | 300,960.00 | 0.04 |
| 95 | 600660 | 福耀玻璃 | 5,200 | 290,420.00 | 0.04 |
| 96 | 688276 | 百克生物 | 3,486 | 277,067.28 | 0.04 |
| 97 | 002318 | 久立特材 | 22,700 | 272,854.00 | 0.04 |
| 98 | 603538 | 美诺华 | 5,700 | 267,900.00 | 0.04 |
| 99 | 01765 | 希望教育 | 170,000 | 264,518.23 | 0.04 |
| 100 | 002831 | 裕同科技 | 8,800 | 261,272.00 | 0.04 |
| 101 | 002821 | 凯莱英 | 700 | 260,820.00 | 0.04 |
| 102 | 601233 | 桐昆股份 | 10,400 | 250,536.00 | 0.04 |
| 103 | 000157 | 中联重科 | 27,100 | 250,404.00 | 0.04 |
| 104 | 000877 | 天山股份 | 18,114 | 236,025.42 | 0.04 |
| 105 | 02382 | 舜宇光学科技 | 1,100 | 224,611.68 | 0.03 |
| 106 | 000547 | 航天发展 | 11,800 | 222,666.00 | 0.03 |
| 107 | 600196 | 复星医药 | 3,000 | 216,390.00 | 0.03 |
| 108 | 002968 | 新大正 | 4,950 | 215,572.50 | 0.03 |
| 109 | 600183 | 生益科技 | 9,000 | 210,690.00 | 0.03 |
| 110 | 601222 | 林洋能源 | 24,500 | 203,105.00 | 0.03 |
| 111 | 002938 | 鹏鼎控股 | 5,500 | 197,340.00 | 0.03 |
| 112 | 000895 | 双汇发展 | 6,200 | 197,160.00 | 0.03 |
| 113 | 603129 | 春风动力 | 1,500 | 186,120.00 | 0.03 |
| 114 | 002028 | 思源电气 | 6,000 | 184,740.00 | 0.03 |
| 115 | 00941 | 中国移动 | 4,500 | 181,788.68 | 0.03 |
| 116 | 300413 | 芒果超媒 | 2,500 | 171,500.00 | 0.03 |
| 117 | 600496 | 精工钢构 | 40,000 | 163,200.00 | 0.02 |
| 118 | 002064 | 华峰化学 | 11,300 | 160,460.00 | 0.02 |
| 119 | 600988 | 赤峰黄金 | 10,600 | 158,894.00 | 0.02 |
| 120 | 600399 | 抚顺特钢 | 8,700 | 157,818.00 | 0.02 |
| 121 | 002223 | 鱼跃医疗 | 4,000 | 152,520.00 | 0.02 |
| 122 | 300529 | 健帆生物 | 1,700 | 146,812.00 | 0.02 |
| 123 | 300628 | 亿联网络 | 1,700 | 142,460.00 | 0.02 |
| 124 | 002402 | 和而泰 | 5,900 | 141,423.00 | 0.02 |
| 125 | 002484 | 江海股份 | 9,100 | 140,868.00 | 0.02 |
| 126 | 00168 | 青岛啤酒股份 | 2,000 | 139,123.78 | 0.02 |
| 127 | 601689 | 拓普集团 | 3,700 | 138,491.00 | 0.02 |
| 128 | 300274 | 阳光电源 | 1,200 | 138,072.00 | 0.02 |
| 129 | 688036 | 传音控股 | 644 | 134,918.00 | 0.02 |
| 130 | 603233 | 大参林 | 2,616 | 133,703.76 | 0.02 |
| 131 | 603986 | 兆易创新 | 700 | 131,530.00 | 0.02 |
| 132 | 600845 | 宝信软件 | 2,470 | 125,723.00 | 0.02 |
| 133 | 300979 | 华利集团 | 1,100 | 125,290.00 | 0.02 |
| 134 | 002653 | 海思科 | 5,800 | 124,816.00 | 0.02 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|--------|------------|------|
| 135 | 600161 | 天坛生物 | 3,600 | 123,300.00 | 0.02 |
| 136 | 601965 | 中国汽研 | 7,100 | 122,688.00 | 0.02 |
| 137 | 603187 | 海容冷链 | 2,800 | 120,064.00 | 0.02 |
| 138 | 002714 | 牧原股份 | 1,960 | 119,207.20 | 0.02 |
| 139 | 002539 | 云图控股 | 13,500 | 117,855.00 | 0.02 |
| 140 | 300659 | 中孚信息 | 3,500 | 117,495.00 | 0.02 |
| 141 | 688109 | 品茗股份 | 1,479 | 114,829.56 | 0.02 |
| 142 | 688526 | 科前生物 | 3,154 | 114,237.88 | 0.02 |
| 143 | 002262 | 恩华药业 | 7,300 | 112,055.00 | 0.02 |
| 144 | 002027 | 分众传媒 | 11,900 | 111,979.00 | 0.02 |
| 145 | 601100 | 恒立液压 | 1,300 | 111,696.00 | 0.02 |
| 146 | 601231 | 环旭电子 | 6,600 | 110,946.00 | 0.02 |
| 147 | 600104 | 上汽集团 | 5,000 | 109,850.00 | 0.02 |
| 148 | 002056 | 横店东磁 | 8,400 | 109,200.00 | 0.02 |
| 149 | 603816 | 顾家家居 | 1,400 | 108,192.00 | 0.02 |
| 150 | 300144 | 宋城演艺 | 6,400 | 107,520.00 | 0.02 |
| 151 | 300470 | 中密控股 | 2,700 | 104,328.00 | 0.02 |
| 152 | 300737 | 科顺股份 | 3,283 | 103,217.52 | 0.02 |
| 153 | 600380 | 健康元 | 7,500 | 102,975.00 | 0.02 |
| 154 | 688323 | 瑞华泰 | 4,513 | 102,806.14 | 0.02 |
| 155 | 603515 | 欧普照明 | 4,000 | 102,680.00 | 0.02 |
| 156 | 601666 | 平煤股份 | 14,400 | 102,384.00 | 0.02 |
| 157 | 601808 | 中海油服 | 7,100 | 101,956.00 | 0.02 |
| 158 | 603517 | 绝味食品 | 1,200 | 101,148.00 | 0.02 |
| 159 | 002601 | 龙蟠佰利 | 2,900 | 100,282.00 | 0.01 |
| 160 | 603279 | 景津环保 | 4,500 | 99,720.00 | 0.01 |
| 161 | 002080 | 中材科技 | 3,800 | 99,446.00 | 0.01 |
| 162 | 300919 | 中伟股份 | 610 | 99,430.00 | 0.01 |
| 163 | 300347 | 泰格医药 | 500 | 96,650.00 | 0.01 |
| 164 | 600507 | 方大特钢 | 14,200 | 96,276.00 | 0.01 |
| 165 | 300724 | 捷佳伟创 | 800 | 92,808.00 | 0.01 |
| 166 | 603416 | 信捷电气 | 1,300 | 82,511.00 | 0.01 |
| 167 | 600048 | 保利地产 | 6,800 | 81,872.00 | 0.01 |
| 168 | 01810 | 小米集团-W | 3,400 | 76,384.94 | 0.01 |
| 169 | 000977 | 浪潮信息 | 2,700 | 75,951.00 | 0.01 |
| 170 | 300776 | 帝尔激光 | 500 | 74,680.00 | 0.01 |
| 171 | 301018 | 申菱环境 | 7,811 | 64,753.19 | 0.01 |
| 172 | 603260 | 合盛硅业 | 800 | 61,528.00 | 0.01 |
| 173 | 002705 | 新宝股份 | 2,300 | 60,375.00 | 0.01 |
| 174 | 000708 | 中信特钢 | 2,700 | 56,268.00 | 0.01 |
| 175 | 300015 | 爱尔眼科 | 778 | 55,222.44 | 0.01 |
| 176 | 300981 | 中红医疗 | 601 | 54,324.39 | 0.01 |
| 177 | 688087 | 英科再生 | 2,469 | 54,219.24 | 0.01 |
| 178 | 03690 | 美团-W | 200 | 53,319.69 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 179 | 600030 | 中信证券 | 2,000 | 49,880.00 | 0.01 |
| 180 | 688260 | 昀冢科技 | 2,990 | 49,065.90 | 0.01 |
| 181 | 300146 | 汤臣倍健 | 1,400 | 46,060.00 | 0.01 |
| 182 | 300894 | 火星人 | 628 | 42,704.00 | 0.01 |
| 183 | 000975 | 银泰黄金 | 4,400 | 41,844.00 | 0.01 |
| 184 | 300973 | 立高食品 | 360 | 41,655.60 | 0.01 |
| 185 | 300525 | 博思软件 | 2,240 | 39,760.00 | 0.01 |
| 186 | 300226 | 上海钢联 | 660 | 39,303.00 | 0.01 |
| 187 | 002242 | 九阳股份 | 1,200 | 38,988.00 | 0.01 |
| 188 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230 | 34,721.10 | 0.01 |
| 189 | 300575 | 中旗股份 | 1,350 | 32,886.00 | 0.00 |
| 190 | 603700 | 宁水集团 | 1,300 | 31,447.00 | 0.00 |
| 191 | 600323 | 瀚蓝环境 | 1,400 | 30,506.00 | 0.00 |
| 192 | 600346 | 恒力石化 | 1,100 | 28,864.00 | 0.00 |
| 193 | 300785 | 值得买 | 300 | 28,500.00 | 0.00 |
| 194 | 300036 | 超图软件 | 1,300 | 28,418.00 | 0.00 |
| 195 | 300136 | 信维通信 | 900 | 27,792.00 | 0.00 |
| 196 | 301021 | 英诺激光 | 2,899 | 27,424.54 | 0.00 |
| 197 | 002697 | 红旗连锁 | 4,800 | 24,672.00 | 0.00 |
| 198 | 600998 | 九州通 | 1,567 | 24,084.79 | 0.00 |
| 199 | 001207 | 联科科技 | 682 | 22,581.02 | 0.00 |
| 200 | 301009 | 可靠股份 | 801 | 22,339.89 | 0.00 |
| 201 | 603583 | 捷昌驱动 | 392 | 19,843.04 | 0.00 |
| 202 | 301015 | 百洋医药 | 462 | 17,939.46 | 0.00 |
| 203 | 688226 | 威腾电气 | 2,693 | 17,289.06 | 0.00 |
| 204 | 300747 | 锐科激光 | 150 | 17,109.00 | 0.00 |
| 205 | 603369 | 今世缘 | 300 | 16,248.00 | 0.00 |
| 206 | 300968 | 格林精密 | 1,162 | 14,025.34 | 0.00 |
| 207 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754 | 13,558.42 | 0.00 |
| 208 | 300937 | 药易购 | 244 | 13,105.24 | 0.00 |
| 209 | 300942 | 易瑞生物 | 443 | 12,634.36 | 0.00 |
| 210 | 603171 | 税友股份 | 637 | 12,230.40 | 0.00 |
| 211 | 300997 | 欢乐家 | 928 | 12,110.40 | 0.00 |
| 212 | 300933 | 中辰股份 | 1,112 | 11,609.28 | 0.00 |
| 213 | 605287 | 德才股份 | 349 | 11,014.44 | 0.00 |
| 214 | 300955 | 嘉亨家化 | 232 | 10,688.24 | 0.00 |
| 215 | 300685 | 艾德生物 | 100 | 10,408.00 | 0.00 |
| 216 | 300996 | 普联软件 | 241 | 10,177.43 | 0.00 |
| 217 | 300956 | 英力股份 | 371 | 9,571.80 | 0.00 |
| 218 | 300962 | 中金辐照 | 576 | 9,429.12 | 0.00 |
| 219 | 300952 | 恒辉安防 | 340 | 9,207.20 | 0.00 |
| 220 | 301016 | 雷尔伟 | 275 | 9,069.50 | 0.00 |
| 221 | 300945 | 曼卡龙 | 474 | 8,949.12 | 0.00 |
| 222 | 300948 | 冠中生态 | 324 | 8,884.08 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 223 | 300931 | 通用电梯 | 672 | 8,809.92 | 0.00 |
| 224 | 300950 | 德固特 | 219 | 8,569.47 | 0.00 |
| 225 | 605162 | 新中港 | 1,377 | 8,358.39 | 0.00 |
| 226 | 300958 | 建工修复 | 300 | 8,166.00 | 0.00 |
| 227 | 300986 | 志特新材 | 264 | 8,070.48 | 0.00 |
| 228 | 300987 | 川网传媒 | 301 | 8,069.81 | 0.00 |
| 229 | 300993 | 玉马遮阳 | 410 | 7,908.90 | 0.00 |
| 230 | 300930 | 屹通新材 | 322 | 7,882.56 | 0.00 |
| 231 | 300985 | 致远新能 | 295 | 7,318.95 | 0.00 |
| 232 | 300991 | 创益通 | 254 | 6,733.54 | 0.00 |
| 233 | 300927 | 江天化学 | 217 | 6,531.70 | 0.00 |
| 234 | 300975 | 商络电子 | 492 | 6,410.76 | 0.00 |
| 235 | 300963 | 中洲特材 | 283 | 6,364.67 | 0.00 |
| 236 | 300943 | 春晖智控 | 255 | 5,867.55 | 0.00 |
| 237 | 300967 | 晓鸣股份 | 507 | 5,850.78 | 0.00 |
| 238 | 300929 | 华骐环保 | 183 | 5,407.65 | 0.00 |
| 239 | 300960 | 通业科技 | 234 | 5,396.04 | 0.00 |
| 240 | 605011 | 杭州热电 | 525 | 4,662.00 | 0.00 |
| 241 | 300995 | 奇德新材 | 191 | 4,454.12 | 0.00 |
| 242 | 300998 | 宁波方正 | 201 | 4,285.32 | 0.00 |
| 243 | 600585 | 海螺水泥 | 100 | 4,105.00 | 0.00 |
| 244 | 301010 | 晶雪节能 | 218 | 3,838.98 | 0.00 |
| 245 | 600332 | 白云山 | 100 | 3,385.00 | 0.00 |
| 246 | 603985 | 恒润股份 | 130 | 2,203.50 | 0.00 |

注：根据龙蟒佰利联集团股份有限公司于 2021 年 7 月 6 日发布的《关于变更注册资本、公司名称及证券简称的公告》，经公司申请，并经深圳证券交易所核准，公司证券简称于 2021 年 7 月 7 日起由“龙蟒佰利”变更为“龙佰集团”，证券代码不变，仍为“002601”。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1 | 00700 | 腾讯控股 | 4,577,767.86 | 0.37 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 2,779,569.00 | 0.23 |
| 3 | 600309 | 万华化学 | 2,521,921.00 | 0.20 |
| 4 | 300059 | 东方财富 | 1,571,081.00 | 0.13 |
| 5 | 601398 | 工商银行 | 999,990.00 | 0.08 |
| 6 | 300702 | 天宇股份 | 999,975.35 | 0.08 |
| 7 | 688819 | 天能股份 | 945,916.65 | 0.08 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 8 | 000513 | 丽珠集团 | 895,847.00 | 0.07 |
| 9 | 002415 | 海康威视 | 799,485.00 | 0.06 |
| 10 | 600383 | 金地集团 | 698,487.00 | 0.06 |
| 11 | 002557 | 洽洽食品 | 671,955.00 | 0.05 |
| 12 | 601288 | 农业银行 | 599,718.00 | 0.05 |
| 13 | 601601 | 中国太保 | 599,460.00 | 0.05 |
| 14 | 300408 | 三环集团 | 579,165.00 | 0.05 |
| 15 | 600036 | 招商银行 | 567,540.00 | 0.05 |
| 16 | 600486 | 扬农化工 | 543,371.00 | 0.04 |
| 17 | 600809 | 山西汾酒 | 515,398.00 | 0.04 |
| 18 | 600989 | 宝丰能源 | 498,433.00 | 0.04 |
| 19 | 600426 | 华鲁恒升 | 495,683.00 | 0.04 |
| 20 | 603883 | 老百姓 | 494,648.00 | 0.04 |

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 12,945,231.00 | 1.05 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 11,876,913.91 | 0.97 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 11,219,618.00 | 0.91 |
| 4 | 600486 | 扬农化工 | 8,242,517.00 | 0.67 |
| 5 | 603218 | 日月股份 | 7,448,655.22 | 0.61 |
| 6 | 600031 | 三一重工 | 6,751,311.00 | 0.55 |
| 7 | 000568 | 泸州老窖 | 5,837,655.00 | 0.47 |
| 8 | 600030 | 中信证券 | 5,770,769.00 | 0.47 |
| 9 | 601012 | 隆基股份 | 5,646,929.00 | 0.46 |
| 10 | 000858 | 五粮液 | 5,633,910.60 | 0.46 |
| 11 | 000333 | 美的集团 | 4,993,070.05 | 0.41 |
| 12 | 300760 | 迈瑞医疗 | 4,955,138.00 | 0.40 |
| 13 | 002726 | 龙大肉食 | 4,929,080.48 | 0.40 |
| 14 | 000538 | 云南白药 | 4,682,493.50 | 0.38 |
| 15 | 002938 | 鹏鼎控股 | 4,173,121.00 | 0.34 |
| 16 | 601088 | 中国神华 | 4,096,999.00 | 0.33 |
| 17 | 600048 | 保利地产 | 3,962,851.61 | 0.32 |
| 18 | 002271 | 东方雨虹 | 3,858,857.00 | 0.31 |
| 19 | 300316 | 晶盛机电 | 3,705,320.00 | 0.30 |
| 20 | 002475 | 立讯精密 | 3,577,363.00 | 0.29 |

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---------------|----------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 41,352,736.97 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 239,400,579.43 |

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 50,185,000.00 | 7.45 |
| | 其中：政策性金融债 | 50,185,000.00 | 7.45 |
| 4 | 企业债券 | 262,482,000.00 | 38.98 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 171,129,000.00 | 25.41 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 32,369,374.16 | 4.81 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 516,165,374.16 | 76.66 |

7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 190202 | 19 国开 02 | 500,000 | 50,185,000.00 | 7.45 |
| 2 | 163617 | 20 藏投 01 | 300,000 | 30,243,000.00 | 4.49 |
| 3 | 101900773 | 19 外高桥 MTN002 | 300,000 | 30,234,000.00 | 4.49 |
| 4 | 112962 | 19 深建 01 | 300,000 | 30,153,000.00 | 4.48 |

| | | | | | |
|---|--------|----------|---------|---------------|------|
| 5 | 155058 | 18 京能 01 | 300,000 | 30,135,000.00 | 4.48 |
|---|--------|----------|---------|---------------|------|

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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 | 公允价值变动 | 风险说明 |
|----------------|--------|--------|----------------|---------------|---------------|
| IF2109 | IF2109 | -17.00 | -26,348,640.00 | -1,499,340.00 | - |
| 公允价值变动总额合计 | | | | | -1,499,340.00 |
| 股指期货投资本期收益 | | | | | -9,325,795.87 |
| 股指期货投资本期公允价值变动 | | | | | 6,526,795.87 |

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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的 20 国开 06 (200206) 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。

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。

7.12.2 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。

7.12.3 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 | 3,259,446.58 |
| 2 | 应收证券清算款 | 9,241,710.84 |
| 3 | 应收股利 | 21,840.00 |
| 4 | 应收利息 | 6,518,802.87 |
| 5 | 应收申购款 | 60,792.05 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 19,102,592.34 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位: 人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|--------------|--------------|
| 1 | 132022 | 20 广版 EB | 2,516,777.00 | 0.37 |
| 2 | 110064 | 建工转债 | 2,096,812.80 | 0.31 |
| 3 | 113505 | 杭电转债 | 2,085,200.00 | 0.31 |

| | | | | |
|----|--------|----------|--------------|------|
| 4 | 128044 | 岭南转债 | 1,776,991.20 | 0.26 |
| 5 | 113017 | 吉视转债 | 1,537,515.00 | 0.23 |
| 6 | 110068 | 龙净转债 | 1,308,320.00 | 0.19 |
| 7 | 128037 | 岩土转债 | 1,181,730.00 | 0.18 |
| 8 | 127016 | 鲁泰转债 | 1,138,400.00 | 0.17 |
| 9 | 113532 | 海环转债 | 1,093,182.00 | 0.16 |
| 10 | 110033 | 国贸转债 | 1,073,778.00 | 0.16 |
| 11 | 110041 | 蒙电转债 | 1,053,600.00 | 0.16 |
| 12 | 128087 | 孚日转债 | 1,051,752.50 | 0.16 |
| 13 | 128064 | 司尔转债 | 1,050,373.20 | 0.16 |
| 14 | 113014 | 林洋转债 | 1,037,388.00 | 0.15 |
| 15 | 113024 | 核建转债 | 1,014,453.00 | 0.15 |
| 16 | 113519 | 长久转债 | 984,640.60 | 0.15 |
| 17 | 110074 | 精达转债 | 865,100.00 | 0.13 |
| 18 | 113030 | 东风转债 | 775,268.40 | 0.12 |
| 19 | 127013 | 创维转债 | 736,750.00 | 0.11 |
| 20 | 113525 | 台华转债 | 727,848.00 | 0.11 |
| 21 | 128081 | 海亮转债 | 723,991.57 | 0.11 |
| 22 | 113534 | 鼎胜转债 | 602,340.00 | 0.09 |
| 23 | 113026 | 核能转债 | 528,650.00 | 0.08 |
| 24 | 113530 | 大丰转债 | 512,400.00 | 0.08 |
| 25 | 110038 | 济川转债 | 490,209.90 | 0.07 |
| 26 | 128107 | 交科转债 | 486,783.04 | 0.07 |
| 27 | 128132 | 交建转债 | 384,120.00 | 0.06 |
| 28 | 123004 | 铁汉转债 | 378,259.74 | 0.06 |
| 29 | 113021 | 中信转债 | 316,710.00 | 0.05 |
| 30 | 128083 | 新北转债 | 310,170.00 | 0.05 |
| 31 | 110052 | 贵广转债 | 303,630.00 | 0.05 |
| 32 | 127020 | 中金转债 | 295,970.60 | 0.04 |
| 33 | 127012 | 招路转债 | 255,908.73 | 0.04 |
| 34 | 123071 | 天能转债 | 232,620.00 | 0.03 |
| 35 | 128071 | 合兴转债 | 212,960.00 | 0.03 |
| 36 | 123059 | 银信转债 | 210,460.00 | 0.03 |
| 37 | 128124 | 科华转债 | 210,200.00 | 0.03 |
| 38 | 132004 | 15 国盛 EB | 204,600.00 | 0.03 |
| 39 | 127019 | 国城转债 | 182,240.00 | 0.03 |
| 40 | 113039 | 嘉泽转债 | 114,510.00 | 0.02 |
| 41 | 128018 | 时达转债 | 114,130.00 | 0.02 |
| 42 | 128127 | 文科转债 | 98,140.00 | 0.01 |
| 43 | 113596 | 城地转债 | 91,220.00 | 0.01 |

7.12.5 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。

§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

| 份额级别 | 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 |
| 海富通富盈混合 A | 3,140 | 64,248.55 | 19,999,000.00 | 9.91% | 181,741,435.76 | 90.09% |
| 海富通富盈混合 C | 4,625 | 90,984.18 | 196,789,233.95 | 46.77% | 224,012,597.20 | 53.23% |
| 合计 | 7,765 | 80,172.86 | 216,788,233.95 | 34.82% | 405,754,032.96 | 65.18% |

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,A、C级比例分母为各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 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 | 海富通富盈混合 A | 68.92 | 0.0000% |
| | 海富通富盈混合 C | 500,030.01 | 0.1188% |
| | 合计 | 500,098.93 | 0.0803% |

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 | 份额级别 | 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 | 海富通富盈混合 A | 0 |
| | 海富通富盈混合 C | 10~50 |
| | 合计 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 海富通富盈混合 A | 0 |
| | 海富通富盈混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 海富通富盈混合 A | 海富通富盈混合 C |
|--------------------------------|------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2020 年 5 月 20 日）基金份额总额 | 1,092,446,802.70 | 1,839,497,101.82 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 508,304,749.87 | 659,478,324.42 |
| 本报告期基金总申购份额 | 21,080,321.01 | 156,586,126.47 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 327,644,635.12 | 395,262,619.74 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 201,740,435.76 | 420,801,831.15 |

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§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

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为毕马威会计师事务所(特殊普通合伙)，未有改聘情况发生。

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 | |
| 海通证券 | 2 | 271,767,779.63 | 100.00% | 197,098.84 | 100.00% | - |

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

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 | |
|------|----------------|------------------|------------------|------------------|------|------------------|
| | 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 |
| 海通证券 | 179,605,945.56 | 100.00% | 4,644,500,000.00 | 100.00% | - | - |

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 | 中国证券报、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 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-05 |
| 3 | 海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-19 |
| 4 | 海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-19 |
| 5 | 海富通基金管理有限公司关于旗下基金获配天宇股份（300702）非公开发行 A 股的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金 | 2021-01-20 |

| | | | |
|----|---|-----------------------------|------------|
| | | 电子披露网站 | |
| 6 | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海联泰基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-28 |
| 7 | 海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-02-02 |
| 8 | 海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-02-04 |
| 9 | 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 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-02-26 |
| 10 | 海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-03-16 |
| 11 | 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 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-03-18 |
| 12 | 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 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-03-22 |
| 13 | 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 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-03-22 |
| 14 | 海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-03-25 |
| 15 | 海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-03-29 |
| 16 | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行招赢通为销售平台的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-03-30 |
| 17 | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波银行股份有限公司为销售机构的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-04-08 |
| 18 | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京度小满基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-04-08 |
| 19 | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增民商基金销售(上海)有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-04-13 |
| 20 | 海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资 | 中国证券报、基金管理人 | 2021-04-15 |

| | | | |
|----|---|-----------------------------|------------|
| | 关联方承销期内承销证券的公告 | 网站及中国证监会基金电子披露网站 | |
| 21 | 海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-04-21 |
| 22 | 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 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-05-06 |
| 23 | 海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-05-11 |
| 24 | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增广东顺德农村商业银行股份有限公司为销售机构的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-05-13 |
| 25 | 海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加中国人寿保险股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-06-30 |

§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获奖名单揭晓，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富盈混合型证券投资基金的文件
- （二）海富通富盈混合型证券投资基金基金合同
- （三）海富通富盈混合型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通富盈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

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