

**海富通富泽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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

## §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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 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> .....	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.....	13
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	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
<b>§7 投资组合报告</b> .....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	57
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.....	57
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.....	57
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57
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.....	58
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60

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
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>61</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>62</b>
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
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>65</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>66</b>
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	海富通富泽混合型证券投资基金	
基金简称	海富通富泽混合	
基金主代码	009156	
交易代码	009156	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 6 月 22 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	857,718,865.58 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C
下属分级基金的交易代码	009156	009157
报告期末下属分级基金的份额总额	574,133,739.12 份	283,585,126.46 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制下跌风险的前提下，通过量化选股和主动债券投资相结合的投资策略，力争实现战胜业绩比较基准的目标，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金以在风险可控下寻求稳定的超额收益作为投资理念，采用稳健的大类资产配置和股票投资策略。本基金通过对宏观经济及证券市场整体走势进行前瞻性研究，同时紧密跟踪资金流向、市场流动性、交易特征和投资者情绪等因素，兼顾经济增长的长期趋势和短期经济周期的波动，结合投资时钟理论，确定基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间的配置比例。并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整组合中各类资产的比例，或借助股指期货等金融工具快速灵活地作出反应，以规避或分散市场风险。股票投资方面，本基金将采用量化选股方法构建股票组合，以价值投资作为核心理念，通过量化模型构建多因子 alpha 模型。本基金投资策略还包括债券投资组合策略、资产支持证券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、股指期货投资策略、流通受限证券投资策略。
业绩比较基准	中债-综合全价（总值）指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

**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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	胡波
	联系电话	021-38650788	021-61618888
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95528
传真		021-33830166	021-63602540
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	上海市中山东一路12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	上海市北京东路689号
邮政编码		200120	200001
法定代表人		杨仓兵	郑杨

**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	<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

**2.5 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）	
	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C
本期已实现收益	19,548,614.13	7,278,943.39

本期利润	22,061,131.20	9,988,941.78
加权平均基金份额本期利润	0.0258	0.0292
本期加权平均净值利润率	2.44%	2.76%
本期基金份额净值增长率	2.47%	2.26%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2021年6月30日)</b>	
	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C
期末可供分配利润	29,196,349.65	13,188,009.85
期末可供分配基金份额利润	0.0509	0.0465
期末基金资产净值	615,224,643.46	302,645,953.79
期末基金份额净值	1.0716	1.0672
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2021年6月30日)</b>	
	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C
基金份额累计净值增长率	7.16%	6.72%

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

海富通富泽混合 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	0.07%	0.19%	-0.38%	0.15%	0.45%	0.04%
过去三个月	1.63%	0.22%	1.00%	0.18%	0.63%	0.04%
过去六个月	2.47%	0.30%	1.01%	0.24%	1.46%	0.06%
过去一年	7.18%	0.25%	4.51%	0.23%	2.67%	0.02%
自基金合同生效起至今	7.16%	0.25%	4.79%	0.23%	2.37%	0.02%

海富通富泽混合 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	0.03%	0.19%	-0.38%	0.15%	0.41%	0.04%
过去三个月	1.52%	0.22%	1.00%	0.18%	0.52%	0.04%

过去六个月	2.26%	0.30%	1.01%	0.24%	1.25%	0.06%
过去一年	6.75%	0.25%	4.51%	0.23%	2.24%	0.02%
自基金合同生效起至今	6.72%	0.25%	4.79%	0.23%	1.93%	0.02%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

#### 海富通富泽混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020 年 6 月 22 日至 2021 年 6 月 30 日)

#### 海富通富泽混合 A



#### 海富通富泽混合 C





注：本基金合同于 2020 年 6 月 22 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。	2020-06-22	-	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。
张靖爽	本基金的基金经理；债券基金部副总监。	2020-06-22	-	11 年	"硕士，持有基金从业人员资格证书。历任中银基金管理有限公司研究员，交银施罗德基金管理有限公司投资经理、基金经理助理、研究员。2016 年 7 月至 2017 年 10 月任海富通双利债券基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 10 月兼任海富通一年定期开放债券基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 11 月兼任海富通纯债债券基金经理。2017 年 8 月起兼任海富通瑞福一年定开债券（现为海富通瑞福债券）和海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2018 年 2 月至 2021 年 2 月任海富通融丰定开债券基金经理。2018 年 11 月至 2020 年 10 月任海富通鼎丰定开债券基金经理。2019 年 5 月起兼任海富通新内需混合基金经理。2019 年 10 月至 2021 年 4 月任海富通聚合纯债基金经理。2019 年 12 月起兼任海富通裕通 30 个月定开债券基金经理。2020 年 4 月起兼任海富通裕昇三年定开债券基金经理。2020 年 5 月起兼任海富通瑞弘 6 个月定开债券基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。 "

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持

有人利益的行为。

### 4.3 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，从经济增长来看，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。

组合在上半年期间维持中等久期，适时进行利率债的波段交易。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通富泽混合 A 净值增长率为 2.47%，同期业绩比较基准收益率为 1.01%，基金

净值跑赢业绩比较基准 1.46 个百分点；海富通富泽混合 C 净值增长率为 2.26%，同期业绩比较基准收益率为 1.01%，基金净值跑赢业绩比较基准 1.25 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。通胀方面，在碳中和政策没有大力推行，油价缺乏大幅上涨的基础上，PPI 后续即使有第二轮高点，大概率或不会超过 5 月份的高点，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。

#### 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，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配后份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去该类份额每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对海富通富泽混合型证券投资基金的托管过程中，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、托管协议的规定，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基金托管人应尽的义务。

#### 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，本托管人依照《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、托管协议的规定，对海富通富泽混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，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的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

### 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

本报告期内，由海富通富泽混合型证券投资基金编制本托管人复核的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”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、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：海富通富泽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	1,587,984.73	12,615,015.83
结算备付金		26,876,518.54	67,835,210.86
存出保证金		3,782,831.12	2,060,151.10
交易性金融资产	6.4.7.2	937,425,195.17	1,323,962,348.27
其中：股票投资		225,397,461.57	289,592,238.15
基金投资		-	-
债券投资		701,998,733.60	1,024,337,110.12
资产支持证券投资		10,029,000.00	10,033,000.00
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	-	133,290,697.74
应收证券清算款		14,310,386.27	3,543,155.26
应收利息	6.4.7.5	13,265,747.38	13,112,020.88
应收股利		53,331.85	-
应收申购款		13,199.40	45,482,246.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		997,315,194.46	1,601,900,846.48
<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		50,000,000.00	22,900,000.00
应付证券清算款		2.87	9,561,554.84
应付赎回款		28,293,074.82	11,494,685.25
应付管理人报酬		652,833.81	1,012,610.39
应付托管费		163,208.50	253,152.61
应付销售服务费		103,606.60	143,226.63
应付交易费用	6.4.7.7	80,623.57	132,903.73
应交税费		42,942.88	33,016.74
应付利息		4,593.26	1,486.07
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	103,710.90	132,437.10
负债合计		79,444,597.21	45,665,073.36
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	857,718,865.58	1,489,041,898.24
未分配利润	6.4.7.10	60,151,731.67	67,193,874.88
所有者权益合计		917,870,597.25	1,556,235,773.12
负债和所有者权益总计		997,315,194.46	1,601,900,846.48

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 857,718,865.58 份。其中海富通富泽混合基金 A 类基金份额总额 574,133,739.12 份，基金份额净值 1.0716 元，海富通富泽混合基金 C 类基金份额总额 283,585,126.46 份，基金份额净值 1.0672 元。

## 6.2 利润表

会计主体：海富通富泽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	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 6 月 22 日（基 金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>39,888,081.41</b>	<b>52,230.61</b>
1.利息收入		16,778,401.33	425,691.76
其中：存款利息收入	6.4.7.11	334,584.47	225,672.51
债券利息收入		15,721,986.66	4,381.43
资产支持证券利息收入		180,280.86	-
买入返售金融资产收入		541,549.34	195,637.82
证券出借利息收入		-	-

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		17,179,292.77	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	15,499,888.60	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	163,995.80	-
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	-554,500.00	-
股利收益	6.4.7.16	2,069,908.37	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,222,515.46	-373,461.15
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	707,871.85	-
<b>减：二、费用</b>		<b>7,838,008.43</b>	<b>247,993.24</b>
1. 管理人报酬		5,050,732.58	157,995.21
2. 托管费		1,262,683.17	39,498.80
3. 销售服务费		721,602.24	29,116.31
4. 交易费用	6.4.7.19	364,068.83	13,706.06
5. 利息支出		286,130.96	-
其中：卖出回购金融资产支出		286,130.96	-
6.税金及附加		28,016.85	15.77
7. 其他费用	6.4.7.20	124,773.80	7,661.09
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>32,050,072.98</b>	<b>-195,762.63</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>32,050,072.98</b>	<b>-195,762.63</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通富泽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）	1,489,041,898.24	67,193,874.88	1,556,235,773.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	32,050,072.98	32,050,072.98
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）	-631,323,032.66	-39,092,216.19	-670,415,248.85

其中：1.基金申购款	272,444,979.32	17,095,876.04	289,540,855.36
2.基金赎回款	-903,768,011.98	-56,188,092.23	-959,956,104.21
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）	857,718,865.58	60,151,731.67	917,870,597.25
项目	上年度可比期间		
	2020年6月22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）	903,461,549.19	-	903,461,549.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-195,762.63	-195,762.63
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）	903,461,549.19	-195,762.63	903,265,786.56

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

海富通富泽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]126号《关于准予海富通富泽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《海富通富泽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 903,252,947.38 元，其中海富通富泽混合 A 为人民币 570,320,022.61 元，

海富通富泽混合 C 为人民币 332,932,924.77 元。经向中国证监会备案,《海富通富泽混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 6 月 22 日正式生效,基金合同生效日的海富通富泽混合 A 基金份额总额为 570,462,800.39 份,其中认购资金利息折合 142,777.78 份基金份额,海富通富泽混合 C 基金份额总额为 332,998,748.80 份,其中认购资金利息折合 65,824.03 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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《海富通富泽混合型证券投资基金基金合同》及《海富通富泽混合型证券投资基金基金招募说明书》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《海富通富泽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 $\times$ 80%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 15%+恒生指数收益率(经汇率调整) $\times$ 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 年上半年度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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。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	1,587,984.73
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,587,984.73

### 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	192,644,166.94	225,397,461.57	32,753,294.63
贵金属投资-金交所黄	-	-	-

金合约				
债券	交易所市场	251,866,213.07	251,416,733.60	-449,479.47
	银行间市场	448,894,380.56	450,582,000.00	1,687,619.44
	合计	700,760,593.63	701,998,733.60	1,238,139.97
资产支持证券		10,000,199.45	10,029,000.00	28,800.55
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		903,404,960.02	937,425,195.17	34,020,235.15

#### 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	-29,263,620.00	-	-	-
——股指期货	-29,263,620.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-29,263,620.00	-	-	-

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-30,998,400.00元，公允价值变动-1,734,780.00元；公允价值变动合计-1,734,780.00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无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	557.48
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	14,740.48
应收债券利息	13,240,701.07
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	146.25
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	9,602.10
合计	13,265,747.38

#### 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	78,798.57
银行间市场应付交易费用	1,825.00
合计	80,623.57

#### 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	11,971.05
应付证券出借违约金	-
预提费用	91,739.85
合计	103,710.90

#### 6.4.7.9 实收基金

海富通富泽混合 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	1,022,189,480.03	1,022,189,480.03
本期申购	161,627,568.05	161,627,568.05
本期赎回（以“-”号填列）	-609,683,308.96	-609,683,308.96
本期末	574,133,739.12	574,133,739.12

海富通富泽混合 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	466,852,418.21	466,852,418.21
本期申购	110,817,411.27	110,817,411.27
本期赎回（以“-”号填列）	-294,084,703.02	-294,084,703.02
本期末	283,585,126.46	283,585,126.46

注：此处赎回含转换出份额。

**6.4.7.10 未分配利润**

海富通富泽混合 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	25,163,418.02	21,662,465.79	46,825,883.81
本期利润	19,548,614.13	2,512,517.07	22,061,131.20
本期基金份额交易产生的变动数	-15,515,682.50	-12,280,428.17	-27,796,110.67
其中：基金申购款	4,042,959.09	6,393,503.37	10,436,462.46
基金赎回款	-19,558,641.59	-18,673,931.54	-38,232,573.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,196,349.65	11,894,554.69	41,090,904.34

海富通富泽混合 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	10,489,149.55	9,878,841.52	20,367,991.07
本期利润	7,278,943.39	2,709,998.39	9,988,941.78

本期基金份额交易产生的变动数	-4,580,083.09	-6,716,022.43	-11,296,105.52
其中：基金申购款	2,823,006.39	3,836,407.19	6,659,413.58
基金赎回款	-7,403,089.48	-10,552,429.62	-17,955,519.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,188,009.85	5,872,817.48	19,060,827.33

#### 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	40,202.29	
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	288,008.16	
其他	6,374.02	
合计	334,584.47	

#### 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	146,826,007.61	
减：卖出股票成本总额	131,326,119.01	
买卖股票差价收入	15,499,888.60	

#### 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	802,550,687.12	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	790,243,574.04	
减：应收利息总额	12,143,117.28	
买卖债券差价收入	163,995.80	

#### 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）	-554,500.00
股指期货差价收入应缴纳增值税额	-
合计	-554,500.00

**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	2,069,908.37
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	2,069,908.37

**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	4,759,615.46
——股票投资	2,408,801.91
——债券投资	2,354,813.55
——资产支持证券投资	-4,000.00
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	462,900.00
——权证投资	-
——股指期货	462,900.00
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	5,222,515.46

**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	707,841.10
基金补差费收入	30.75

合计	707,871.85
----	------------

**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	357,443.83
银行间市场交易费用	6,625.00
合计	364,068.83

**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	493.20
银行划款手续费	13,660.75
其他费用	600.00
债券托管账户维护费	17,880.00
开户费	400.00
合计	124,773.80

**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、登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”)	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6月22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	201,915,968.03	100.00%	16,207,158.00	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	147,579.30	100.00%	78,798.57	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2020年6月22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	11,755.99	100.00%	11,755.99	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6月22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	5,050,732.58	157,995.21
其中：支付销售机构的客户维护费	2,178,214.48	67,552.72

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 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年6月22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	1,262,683.17	39,498.80

注：支付基金托管人上海浦东发展银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

##### 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		
	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C	合计
浦发银行	-	403,634.91	403,634.91
海通证券	-	1,640.07	1,640.07
海富通基金	-	264,532.89	264,532.89
合计	-	669,807.87	669,807.87
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020年6月22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		
	海富通富泽混合A	海富通富泽混合C	合计
浦发银行	-	18,655.70	18,655.70
海通证券	-	37.92	37.92
海富通基金	-	4,283.95	4,283.95
合计	-	22,977.57	22,977.57

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：

海富通富泽混合 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6月22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
上海浦东发展银行	1,587,984.73	40,202.29	310,850,611.99	145,172.51

注：本基金通过“上海浦东发展银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2021 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 26,876,518.54 元。

#### 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	300940	南极光	网下发行	3,068	39,147.68
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 6 月 22 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	新股锁定	80.95	34.49	22,235	999,975.35	766,885.15	2
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	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股锁定	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-20	新股锁定	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	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	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	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	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定	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	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	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	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	3
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股锁定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股锁定	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	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	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	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	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	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	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	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	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	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	高络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股锁定	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股锁定	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	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	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	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	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	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	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	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	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	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	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-

301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,811	64,753.19	64,753.19	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688092	爱科科技	2021-03-12	2021-09-22	新股锁定	19.11	33.21	1,137	21,728.07	37,759.77	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688533	上声电子	2021-04-09	2021-10-19	新股锁定	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23	-
688609	九联科技	2021-03-15	2021-09-23	新股锁定	3.99	15.29	10,372	41,384.28	158,587.88	-
688626	翔宇医疗	2021-03-23	2021-10-08	新股锁定	28.82	104.16	3,652	105,250.64	380,392.32	-
688661	和林微纳	2021-03-19	2021-09-29	新股锁定	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52	-
688700	东威科技	2021-06-07	2021-12-15	新股锁定	9.41	38.46	3,049	28,691.09	117,264.54	-

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,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余额人民币 50,000,000.00 元,于 2021 年 7 月 2 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 54.90%(2020 年 12 月 31 日：44.00%)。

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	10,063,000.00	9,974,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	54,000,000.00	71,628,435.00
合计	64,063,000.00	81,602,435.00

注：未评级债券为国债。

**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	58,822,000.00	254,611,000.00
合计	58,822,000.00	254,611,000.00

**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	289,190,583.00	274,491,831.00
AAA 以下	135,794,615.90	135,688,044.12
未评级	154,128,534.70	277,943,800.00
合计	579,113,733.60	688,123,675.12

注：未评级债券为国债及政策性金融债。

**6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

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	10,029,000.00	10,033,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	10,029,000.00	10,033,000.00

**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余额中有人民币 50,000,000.00 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同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，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）。

本基金所持的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 1.36%。

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	1,587,984.73	-	-	-	1,587,984.73
结算备付金	26,876,518.54	-	-	-	26,876,518.54
存出保证金	3,782,831.12	-	-	-	3,782,831.12
交易性金融资产	147,301,914.70	561,647,607.90	3,078,211.00	225,397,461.57	937,425,195.17
应收股利	-	-	-	53,331.85	53,331.85
应收证券清算款	-	-	-	14,310,386.27	14,310,386.27
应收利息	-	-	-	13,265,747.38	13,265,747.38
应收申购款	-	-	-	13,199.40	13,199.40
资产总计	179,549,249.09	561,647,607.90	3,078,211.00	253,040,126.47	997,315,194.46
负债					
卖出回购金融资产款	50,000,000.00	-	-	-	50,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	2.87	2.87

应付赎回款	-	-	-	28,293,074.82	28,293,074.82
应付管理人报酬	-	-	-	652,833.81	652,833.81
应付托管费	-	-	-	163,208.50	163,208.50
应付销售服务费	-	-	-	103,606.60	103,606.60
应付交易费用	-	-	-	80,623.57	80,623.57
应交税费	-	-	-	42,942.88	42,942.88
应付利息	-	-	-	4,593.26	4,593.26
其他负债	-	-	-	103,710.90	103,710.90
负债总计	50,000,000.00	-	-	29,444,597.21	79,444,597.21
利率敏感度缺口	129,549,249.09	561,647,607.90	3,078,211.00	223,595,529.26	917,870,597.25
<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	12,615,015.83	-	-	-	12,615,015.83
结算备付金	67,835,210.86	-	-	-	67,835,210.86
存出保证金	2,060,151.10	-	-	-	2,060,151.10
交易性金融资产	352,296,235.00	657,657,711.50	24,416,163.62	289,592,238.15	1,323,962,348.27
买入返售金融资产	133,290,697.74	-	-	-	133,290,697.74
应收证券清算款	-	-	-	3,543,155.26	3,543,155.26
应收利息	-	-	-	13,112,020.88	13,112,020.88
应收申购款	20,000,000.00	-	-	25,482,246.54	45,482,246.54
资产总计	588,097,310.53	657,657,711.50	24,416,163.62	331,729,660.83	1,601,900,846.48
负债					
卖出回购金融资产款	22,900,000.00	-	-	-	22,900,000.00
应付证券清算款	-	-	-	9,561,554.84	9,561,554.84
应付赎回款	-	-	-	11,494,685.25	11,494,685.25
应付管理人报酬	-	-	-	1,012,610.39	1,012,610.39
应付托管费	-	-	-	253,152.61	253,152.61
应付销售服务费	-	-	-	143,226.63	143,226.63
应付交易费用	-	-	-	132,903.73	132,903.73
应交税费	-	-	-	33,016.74	33,016.74

应付利息	-	-	-	1,486.07	1,486.07
其他负债	-	-	-	132,437.10	132,437.10
负债总计	22,900,000.00	-	-	22,765,073.36	45,665,073.36
利率敏感度缺口	565,197,310.53	657,657,711.50	24,416,163.62	308,964,587.47	1,556,235,773.12

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
	市场利率上升 25 个基点	-3,596,770.83	-4,806,394.25
市场利率下降 25 个基点	3,635,185.71	4,851,417.57	

#### 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			
交易性金融资产	-	12,934,200.99	12,934,200.99
应收股利	-	53,331.85	53,331.85
资产合计	-	12,987,532.84	12,987,532.84

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	-	12,987,532.84	12,987,532.84
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			
交易性金融资 产	-	9,966,465.21	9,966,465.21
资产合计	-	9,966,465.21	9,966,465.21
以外币计价的 负债			
应付证券清算 款	-	1,197,801.24	1,197,801.24
负债合计	-	1,197,801.24	1,197,801.24
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	8,768,663.97	8,768,663.97

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他变量不变		
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%	649,376.64	438,433.20
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-649,376.64	-438,433.20

#### 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	225,397,461. 57	24.56	289,592,238.1 5	18.61
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	225,397,461. 57	24.56	289,592,238.1 5	18.61

##### 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
	业绩比较基准（附注 6.4.1）上升 5%	9,438,027.17	13,779,795.46
业绩比较基准（附注 6.4.1）下降 5%	-9,438,027.17	-13,779,795.46	

#### 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	225,397,461.57	22.60
	其中：股票	225,397,461.57	22.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	712,027,733.60	71.39
	其中：债券	701,998,733.60	70.39
	资产支持证券	10,029,000.00	1.01
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	28,464,503.27	2.85
8	其他各项资产	31,425,496.02	3.15
9	合计	997,315,194.46	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 12,174,462.03 元，占资产净值比例为 1.33%；

通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 759,738.96 元，占资产净值比例为 0.08%。

## 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	244,265.18	0.03
B	采矿业	6,387,632.20	0.70
C	制造业	147,241,929.56	16.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,345,330.39	1.24
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	1,983,980.08	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	187,720.00	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,264,557.90	0.57
J	金融业	32,086,710.10	3.50
K	房地产业	2,879,485.00	0.31
L	租赁和商务服务业	1,746,348.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	1,305,936.00	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	22,457.73	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,358,200.00	0.15
R	文化、体育和娱乐业	397,694.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	212,463,260.58	23.15

### 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	380,077.50	0.04
非日常生活消费品	459,640.99	0.05
日常消费品	278,247.55	0.03
能源	742,073.91	0.08
金融	1,168,639.72	0.13
信息技术	375,334.65	0.04

通信服务	9,530,186.67	1.04
合计	12,934,200.99	1.41

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	177,900	9,640,401.00	1.05
2	00700	腾讯控股	17,700	8,601,044.54	0.94
3	600519	贵州茅台	4,000	8,226,800.00	0.90
4	601012	隆基股份	66,640	5,920,297.60	0.65
5	601166	兴业银行	285,000	5,856,750.00	0.64
6	600031	三一重工	187,100	5,438,997.00	0.59
7	600900	长江电力	261,000	5,387,040.00	0.59
8	002415	海康威视	81,900	5,282,550.00	0.58
9	601966	玲珑轮胎	109,955	4,809,431.70	0.52
10	002311	海大集团	56,886	4,641,897.60	0.51
11	000001	平安银行	203,100	4,594,122.00	0.50
12	600309	万华化学	40,700	4,428,974.00	0.48
13	002142	宁波银行	105,300	4,103,541.00	0.45
14	000568	泸州老窖	17,200	4,058,168.00	0.44
15	000333	美的集团	55,200	3,939,624.00	0.43
16	000661	长春高新	10,100	3,908,700.00	0.43
17	600438	通威股份	80,800	3,496,216.00	0.38
18	002475	立讯精密	71,400	3,284,400.00	0.36
19	002332	仙琚制药	250,100	3,136,254.00	0.34
20	000338	潍柴动力	173,000	3,091,510.00	0.34
21	300760	迈瑞医疗	6,300	3,024,315.00	0.33
22	600887	伊利股份	81,500	3,001,645.00	0.33
23	601318	中国平安	45,400	2,918,312.00	0.32
24	300316	晶盛机电	56,200	2,838,100.00	0.31
25	601225	陕西煤业	235,000	2,784,750.00	0.30
26	300014	亿纬锂能	24,800	2,577,464.00	0.28
27	600563	法拉电子	16,000	2,533,760.00	0.28
28	000739	普洛药业	75,200	2,210,880.00	0.24
29	600276	恒瑞医药	31,320	2,128,820.40	0.23
30	300059	东方财富	64,200	2,105,118.00	0.23
31	600989	宝丰能源	152,000	2,079,360.00	0.23
32	000858	五粮液	6,900	2,055,441.00	0.22
33	000513	丽珠集团	40,800	2,040,816.00	0.22



34	600741	华域汽车	76,700	2,014,909.00	0.22
35	600176	中国巨石	127,444	1,976,656.44	0.22
36	600406	国电南瑞	83,760	1,946,582.40	0.21
37	601899	紫金矿业	191,700	1,857,573.00	0.20
38	002271	东方雨虹	28,200	1,560,024.00	0.17
39	601888	中国中免	5,000	1,500,500.00	0.16
40	600803	新奥股份	90,400	1,492,504.00	0.16
41	300122	智飞生物	7,900	1,475,167.00	0.16
42	601398	工商银行	281,700	1,456,389.00	0.16
43	600461	洪城环境	198,400	1,440,384.00	0.16
44	002557	洽洽食品	33,400	1,439,540.00	0.16
45	601636	旗滨集团	76,600	1,421,696.00	0.15
46	600570	恒生电子	15,200	1,417,400.00	0.15
47	002727	一心堂	40,300	1,334,333.00	0.15
48	002430	杭氧股份	38,300	1,324,797.00	0.14
49	600690	海尔智家	48,500	1,256,635.00	0.14
50	000786	北新建材	31,100	1,220,675.00	0.13
51	002241	歌尔股份	28,500	1,218,090.00	0.13
52	000725	京东方 A	191,700	1,196,208.00	0.13
53	03908	中金公司	67,200	1,168,639.72	0.13
54	600917	重庆燃气	139,000	1,135,630.00	0.12
55	688063	派能科技	5,499	1,082,203.20	0.12
56	002493	荣盛石化	60,900	1,051,743.00	0.11
57	601088	中国神华	53,100	1,036,512.00	0.11
58	603259	药明康德	6,600	1,033,494.00	0.11
59	300979	华利集团	9,246	1,028,699.40	0.11
60	000598	兴蓉环境	196,800	1,025,328.00	0.11
61	002008	大族激光	25,000	1,009,750.00	0.11
62	000538	云南白药	8,600	995,192.00	0.11
63	002511	中顺洁柔	35,800	986,290.00	0.11
64	600486	扬农化工	8,600	961,222.00	0.10
65	603882	金城医学	6,000	958,620.00	0.10
66	300408	三环集团	22,400	950,208.00	0.10
67	000100	TCL 科技	124,000	948,600.00	0.10
68	300454	深信服	3,600	934,128.00	0.10
69	00941	中国移动	23,000	929,142.13	0.10
70	601288	农业银行	305,800	926,574.00	0.10
71	603678	火炬电子	13,100	884,250.00	0.10
72	600522	中天科技	87,000	870,000.00	0.09
73	601877	正泰电器	26,053	869,649.14	0.09
74	603501	韦尔股份	2,700	869,400.00	0.09
75	002039	黔源电力	58,800	851,424.00	0.09
76	002001	新 和 成	29,160	836,308.80	0.09
77	600383	金地集团	75,600	774,144.00	0.08

78	300702	天宇股份	22,235	766,885.15	0.08
79	600426	华鲁恒升	24,570	760,441.50	0.08
80	002541	鸿路钢构	12,800	746,880.00	0.08
81	00883	中国海洋石油	101,000	742,073.91	0.08
82	600048	保利地产	60,200	724,808.00	0.08
83	300037	新宙邦	7,200	720,720.00	0.08
84	600298	安琪酵母	13,200	717,816.00	0.08
85	002258	利尔化学	26,900	694,020.00	0.08
86	002138	顺络电子	17,000	659,090.00	0.07
87	603218	日月股份	23,600	639,088.00	0.07
88	002968	新大正	13,800	600,990.00	0.07
89	000581	威孚高科	26,600	554,078.00	0.06
90	002601	龙蟒佰利	16,000	553,280.00	0.06
91	600585	海螺水泥	13,300	545,965.00	0.06
92	000830	鲁西化工	27,600	516,948.00	0.06
93	000002	万科A	21,700	516,677.00	0.06
94	600521	华海药业	24,710	515,944.80	0.06
95	002444	巨星科技	14,800	504,384.00	0.05
96	300750	宁德时代	900	481,320.00	0.05
97	000651	格力电器	9,200	479,320.00	0.05
98	300146	汤臣倍健	14,300	470,470.00	0.05
99	002304	洋河股份	2,200	455,840.00	0.05
100	601211	国泰君安	26,300	450,782.00	0.05
101	300529	健帆生物	5,200	449,072.00	0.05
102	300628	亿联网络	5,300	444,140.00	0.05
103	600885	宏发股份	6,900	432,630.00	0.05
104	603987	康德莱	16,000	416,000.00	0.05
105	600660	福耀玻璃	7,200	402,120.00	0.04
106	002028	思源电气	12,700	391,033.00	0.04
107	002709	天赐材料	3,570	380,490.60	0.04
108	688626	翔宇医疗	3,652	380,392.32	0.04
109	00826	天工国际	138,000	380,077.50	0.04
110	01765	希望教育	244,000	379,661.46	0.04
111	603538	美诺华	8,000	376,000.00	0.04
112	603129	春风动力	3,000	372,240.00	0.04
113	000157	中联重科	39,100	361,284.00	0.04
114	600196	复星医药	4,800	346,224.00	0.04
115	002064	华峰化学	23,400	332,280.00	0.04
116	000547	航天发展	17,200	324,564.00	0.04
117	600580	卧龙电驱	24,100	320,530.00	0.03
118	601222	林洋能源	37,600	311,704.00	0.03
119	603816	顾家家居	3,800	293,664.00	0.03
120	300782	卓胜微	540	290,250.00	0.03
121	601233	桐昆股份	11,800	284,262.00	0.03

122	00168	青岛啤酒股份	4,000	278,247.55	0.03
123	300114	中航电测	18,300	278,160.00	0.03
124	002318	久立特材	23,000	276,460.00	0.03
125	601799	星宇股份	1,200	270,864.00	0.03
126	300244	迪安诊断	6,900	264,270.00	0.03
127	000656	金科股份	45,400	262,866.00	0.03
128	002938	鹏鼎控股	7,100	254,748.00	0.03
129	688169	石头科技	200	252,200.00	0.03
130	002594	比亚迪	1,000	251,000.00	0.03
131	02382	舜宇光学科技	1,200	245,030.92	0.03
132	002714	牧原股份	3,920	238,414.40	0.03
133	688036	传音控股	1,137	238,201.50	0.03
134	300073	当升科技	4,200	235,998.00	0.03
135	002223	鱼跃医疗	6,100	232,593.00	0.03
136	600399	抚顺特钢	12,800	232,192.00	0.03
137	000063	中兴通讯	6,900	229,287.00	0.02
138	002821	凯莱英	600	223,560.00	0.02
139	002402	和而泰	9,300	222,921.00	0.02
140	600507	方大特钢	32,400	219,672.00	0.02
141	300525	博思软件	12,320	218,680.00	0.02
142	002027	分众传媒	22,700	213,607.00	0.02
143	300413	芒果超媒	3,100	212,660.00	0.02
144	002706	良信股份	9,360	210,974.40	0.02
145	600028	中国石化	46,900	204,484.00	0.02
146	603298	杭叉集团	11,200	203,168.00	0.02
147	002484	江海股份	13,100	202,788.00	0.02
148	300274	阳光电源	1,700	195,602.00	0.02
149	600161	天坛生物	5,700	195,225.00	0.02
150	603369	今世缘	3,600	194,976.00	0.02
151	300575	中旗股份	7,950	193,662.00	0.02
152	300470	中密控股	5,000	193,200.00	0.02
153	002179	中航光电	2,400	189,648.00	0.02
154	603986	兆易创新	1,000	187,900.00	0.02
155	001965	招商公路	26,000	187,720.00	0.02
156	603658	安图生物	2,470	187,151.90	0.02
157	603601	再升科技	16,100	186,277.00	0.02
158	300724	捷佳伟创	1,600	185,616.00	0.02
159	603517	绝味食品	2,200	185,438.00	0.02
160	600845	宝信软件	3,640	185,276.00	0.02
161	002539	云图控股	21,000	183,330.00	0.02
162	600988	赤峰黄金	11,900	178,381.00	0.02
163	300451	创业慧康	20,150	178,126.00	0.02
164	688526	科前生物	4,878	176,681.16	0.02
165	000915	华特达因	6,600	176,418.00	0.02

166	601965	中国汽研	10,200	176,256.00	0.02
167	603187	海容冷链	4,060	174,092.80	0.02
168	601231	环旭电子	10,300	173,143.00	0.02
169	601689	拓普集团	4,600	172,178.00	0.02
170	002056	横店东磁	13,000	169,000.00	0.02
171	000708	中信特钢	8,000	166,720.00	0.02
172	002007	华兰生物	4,500	165,060.00	0.02
173	603368	柳药股份	8,300	163,842.00	0.02
174	601100	恒立液压	1,900	163,248.00	0.02
175	688109	品茗股份	2,095	162,655.80	0.02
176	603416	信捷电气	2,500	158,675.00	0.02
177	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.02
178	688089	嘉必优	3,420	156,978.00	0.02
179	002080	中材科技	5,900	154,403.00	0.02
180	603515	欧普照明	5,700	146,319.00	0.02
181	600380	健康元	10,500	144,165.00	0.02
182	601808	中海油服	10,000	143,600.00	0.02
183	601666	平煤股份	20,000	142,200.00	0.02
184	002653	海思科	6,600	142,032.00	0.02
185	300659	中孚信息	4,200	140,994.00	0.02
186	300144	宋城演艺	8,200	137,760.00	0.02
187	300347	泰格医药	700	135,310.00	0.01
188	300776	帝尔激光	900	134,424.00	0.01
189	01810	小米集团-W	5,800	130,303.73	0.01
190	002262	恩华药业	8,100	124,335.00	0.01
191	002242	九阳股份	3,800	123,462.00	0.01
192	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.01
193	603883	老百姓	2,280	120,110.40	0.01
194	688700	东威科技	3,049	117,264.54	0.01
195	600183	生益科技	5,000	117,050.00	0.01
196	300737	科顺股份	3,600	113,184.00	0.01
197	300003	乐普医疗	3,500	112,420.00	0.01
198	600998	九州通	7,300	112,201.00	0.01
199	688639	华恒生物	2,302	110,472.98	0.01
200	300639	凯普生物	3,254	107,414.54	0.01
201	603233	大参林	2,040	104,264.40	0.01
202	000425	徐工机械	16,200	103,194.00	0.01
203	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
204	002507	涪陵榨菜	2,600	97,916.00	0.01
205	603260	合盛硅业	1,200	92,292.00	0.01
206	300577	开润股份	4,100	87,863.00	0.01
207	002967	广电计量	2,000	87,600.00	0.01
208	002831	裕同科技	2,900	86,101.00	0.01
209	300136	信维通信	2,700	83,376.00	0.01

210	000977	浪潮信息	2,948	82,927.24	0.01
211	002705	新宝股份	3,100	81,375.00	0.01
212	603939	益丰药房	1,430	80,208.70	0.01
213	03690	美团-W	300	79,979.53	0.01
214	603700	宁水集团	3,200	77,408.00	0.01
215	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.01
216	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
217	002595	豪迈科技	2,400	64,080.00	0.01
218	603279	景津环保	2,800	62,048.00	0.01
219	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.01
220	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
221	600346	恒力石化	1,800	47,232.00	0.01
222	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
223	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
224	000975	银泰黄金	4,220	40,132.20	0.00
225	600373	中文传媒	3,900	38,454.00	0.00
226	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.00
227	000877	天山股份	2,800	36,484.00	0.00
228	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
229	002127	南极电商	3,300	32,241.00	0.00
230	000895	双汇发展	1,000	31,800.00	0.00
231	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
232	002602	世纪华通	3,700	23,754.00	0.00
233	002697	红旗连锁	4,400	22,616.00	0.00
234	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
235	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
236	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
237	002459	晶澳科技	400	19,600.00	0.00
238	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
239	002014	永新股份	2,000	17,300.00	0.00
240	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
241	300572	安车检测	500	16,220.00	0.00
242	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
243	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
244	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
245	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
246	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
247	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
248	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
249	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
250	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
251	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
252	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
253	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00

254	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
255	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
256	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
257	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
258	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
259	601098	中南传媒	1,000	8,820.00	0.00
260	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
261	603018	华设集团	1,080	8,586.00	0.00
262	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
263	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
264	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
265	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
266	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
267	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
268	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
269	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
270	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
271	300036	超图软件	300	6,558.00	0.00
272	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
273	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
274	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
275	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
276	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
277	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
278	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
279	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
280	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
281	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
282	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

注：1、根据浙江华峰氨纶股份有限公司于 2021 年 1 月 4 日发布的《关于公司名称及经营范围变更完成的公告》，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 1 月 4 日起由“华峰氨纶”变更为“华峰化学”，证券代码不变，仍为“002064”。

2、根据龙鳞佰利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“龙鳞佰利”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	7,085,880.95	0.46
2	600309	万华化学	2,289,575.00	0.15
3	600031	三一重工	1,996,258.00	0.13
4	002415	海康威视	1,889,880.00	0.12
5	600276	恒瑞医药	1,777,869.61	0.11
6	601012	隆基股份	1,776,900.00	0.11
7	601398	工商银行	1,499,598.00	0.10
8	600570	恒生电子	1,234,437.00	0.08
9	600438	通威股份	1,109,821.20	0.07
10	300702	天宇股份	999,975.35	0.06
11	601288	农业银行	999,966.00	0.06
12	000333	美的集团	999,615.00	0.06
13	688819	天能股份	966,686.28	0.06
14	002727	一心堂	965,215.00	0.06
15	00941	中国移动	960,795.40	0.06
16	002142	宁波银行	876,060.00	0.06
17	002511	中顺洁柔	851,733.00	0.05
18	02601	中国太保	832,424.46	0.05
19	600486	扬农化工	799,416.00	0.05
20	601166	兴业银行	798,634.00	0.05

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。

#### 7.4.2 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	000538	云南白药	6,323,577.00	0.41
2	600486	扬农化工	6,159,513.15	0.40
3	601318	中国平安	4,795,148.00	0.31
4	600519	贵州茅台	4,281,181.00	0.28
5	01336	新华保险	4,167,022.15	0.27
6	600563	法拉电子	4,041,601.00	0.26
7	300607	拓斯达	3,887,114.80	0.25
8	600585	海螺水泥	3,764,142.00	0.24
9	600048	保利地产	3,533,368.00	0.23
10	000333	美的集团	3,489,468.68	0.22
11	603218	日月股份	3,021,948.00	0.19
12	000157	中联重科	2,980,214.33	0.19
13	600521	华海药业	2,795,612.00	0.18

14	600741	华域汽车	2,717,483.33	0.17
15	600887	伊利股份	2,644,754.00	0.17
16	002602	世纪华通	2,593,292.00	0.17
17	600438	通威股份	2,495,376.00	0.16
18	000002	万科 A	2,463,682.00	0.16
19	601012	隆基股份	2,369,242.00	0.15
20	600690	海尔智家	2,233,946.00	0.14

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	64,722,540.52
卖出股票的收入（成交）总额	146,826,007.61

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	134,322,000.00	14.63
2	央行票据	-	-
3	金融债券	114,304,534.70	12.45
	其中：政策性金融债	73,806,534.70	8.04
4	企业债券	204,624,000.00	22.29
5	企业短期融资券	10,063,000.00	1.10
6	中期票据	163,545,000.00	17.82
7	可转债（可交换债）	16,318,198.90	1.78
8	同业存单	58,822,000.00	6.41
9	其他	-	-
10	合计	701,998,733.60	76.48



## 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	200313	20 进出 13	700,000	70,637,000.00	7.70
2	019640	20 国债 10	540,000	54,000,000.00	5.88
3	200013	20 付息国债 13	500,000	50,205,000.00	5.47
4	112012127	20 北京银行 CD127	400,000	39,076,000.00	4.26
5	101900521	19 宜昌城控 MTN003	300,000	31,161,000.00	3.39

## 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	2089344	20 招银和智 2 优先 A1	100,000	10,029,000.00	1.09

## 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	-20.00	-30,998,400.00	-1,734,780.00	-
公允价值变动总额合计					-1,734,780.00
股指期货投资本期收益					-554,500.00
股指期货投资本期公允价值变动					462,900.00

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根据风险管理的原则，以套期保值为目的。本基金管理人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。符合既定投资政策及投资目标。

## 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 北京银行 CD127（112012127）的发行人，因在债务融资工具注册发行和后续管理期间尽职调查工作未遵循勤勉尽责原则、未保证调查质量，未对康得新参与现金管理业务的情况进行充分尽职调查并督导披露。未监测到康得新将募集资金划出体外的情况并督导披露募集资金用途变更信息，被中国银行间市场交易协会处以警告处分并暂停债务融资工具主承销相关业务 6 个月。发行人因同业投资对资产转让业务承担回购义务，同业投资资产风险分类调整不及时、延缓风险暴露，收费管理政策执行不严、违规收取相关费用，个人贷款自主支付管理薄弱、贷款资金违规流入股市、房市，于 2020 年 7 月 11 日被北京银保监局责令改正，并给予合计 150 万元罚款、对相关责任人给予警告的行政处罚。发行人因现金管理业务内部控制存在缺陷，以及某支行出具与事实不符的询证函回函和存款证明、内部控制存在缺陷，于 2020 年 12 月 23 日被北京银保监局责令改正，并给予合计 350 万元罚款的行政处罚；并对相关责任人处以取消 5 年董事、高级管理人员任职资格、或相应金额罚款的行政处罚。发行人因对外销售虚假金融产品、出具与事实不符的单位定期存款开户证实书、关键业务环节管理失控、同城清算业务凭证要件信息不真实、印章管理混乱等违规行为，于 2020 年 12 月 30 日被北京银保监局责令改正，并给予合计 3940 万元罚款的行政处罚；对相关责任人分别给予禁止一定期限从事银行业工作、取消一定期限董事/高级管理人员任职资格、或相应金额罚款的行政处罚。

对该证券的投资决策程序的说明：银行业整体信用水平高，且该银行为地区中型银行，综合实力强，

信用风险可控。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	3,782,831.12
2	应收证券清算款	14,310,386.27
3	应收股利	53,331.85
4	应收利息	13,265,747.38
5	应收申购款	13,199.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,425,496.02

### 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	127012	招路转债	1,391,390.00	0.15
2	110064	建工转债	1,085,920.00	0.12
3	110033	国贸转债	1,039,140.00	0.11
4	110074	精达转债	865,100.00	0.09
5	128083	新北转债	723,730.00	0.08
6	110068	龙净转债	633,025.60	0.07
7	113525	台华转债	606,540.00	0.07
8	113532	海环转债	601,200.00	0.07
9	128081	海亮转债	568,550.00	0.06
10	113505	杭电转债	555,705.80	0.06
11	113508	新风转债	519,240.00	0.06
12	113024	核建转债	502,103.00	0.05
13	113017	吉视转债	488,100.00	0.05

14	128132	交建转债	480,150.00	0.05
15	127013	创维转债	473,625.00	0.05
16	113014	林洋转债	405,416.00	0.04
17	127016	鲁泰转债	357,100.00	0.04
18	128071	合兴转债	319,440.00	0.03
19	113026	核能转债	317,190.00	0.03
20	123059	银信转债	315,690.00	0.03
21	110038	济川转债	314,910.00	0.03
22	113039	嘉泽转债	286,275.00	0.03
23	128044	岭南转债	239,100.00	0.03
24	113030	东风转债	220,560.00	0.02
25	128125	华阳转债	215,816.00	0.02
26	123049	维尔转债	215,720.00	0.02
27	128124	科华转债	210,200.00	0.02
28	110052	贵广转债	202,420.00	0.02
29	127019	国城转债	182,240.00	0.02
30	113034	滨化转债	172,820.00	0.02
31	128101	联创转债	122,380.00	0.01
32	123071	天能转债	116,310.00	0.01
33	110051	中天转债	114,830.00	0.01
34	128018	时达转债	114,130.00	0.01
35	110043	无锡转债	112,680.00	0.01
36	127020	中金转债	109,700.00	0.01
37	110034	九州转债	108,240.00	0.01
38	128037	岩土转债	107,430.00	0.01
39	113599	嘉友转债	107,370.00	0.01
40	113021	中信转债	105,570.00	0.01
41	110041	蒙电转债	105,360.00	0.01
42	113530	大丰转债	102,480.00	0.01
43	113519	长久转债	102,460.00	0.01
44	132022	20 广版 EB	100,270.00	0.01
45	128127	文科转债	98,140.00	0.01
46	113596	城地转债	91,220.00	0.01
47	128087	孚日转债	25,652.50	0.00

#### 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
海富通富泽混合 A	3,944	145,571.43	18,552,822.47	3.23%	555,580,916.65	96.77%
海富通富泽混合 C	1,051	269,824.10	133,848,562.78	47.20%	149,736,563.68	52.80%
合计	4,995	171,715.49	152,401,385.25	17.77%	705,317,480.33	82.23%

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	海富通富泽混合 A	19,359.65	0.0034%
	海富通富泽混合 C	10.00	0.0000%
	合计	19,369.65	0.0023%

## 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	海富通富泽混合 A	0
	海富通富泽混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通富泽混合 A	0
	海富通富泽混合 C	0
	合计	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通富泽混合 A	海富通富泽混合 C
基金合同生效日(2020年6月22日)基金份额总额	570,462,800.39	332,998,748.80
本报告期期初基金份额总额	1,022,189,480.03	466,852,418.21
本报告期基金总申购份额	161,627,568.05	110,817,411.27

减：本报告期基金总赎回份额	609,683,308.96	294,084,703.02
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	574,133,739.12	283,585,126.46

注：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华振会计师事务所（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	201,915,968.03	100.00%	147,579.30	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	117,884,365.28	100.00%	3,026,300,000.00	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电子披露网站	2021-01-20
6	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	2021-01-29
7	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	2021-02-02

	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	
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	2021-04-15
19	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
20	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
21	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泽混合型证券投资基金的文件
- (二) 海富通富泽混合型证券投资基金基金合同
- (三) 海富通富泽混合型证券投资基金招募说明书
- (四) 海富通富泽混合型证券投资基金托管协议
- (五) 中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六) 法律法规及中国证监会规定的其他文件

### 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