

海富通科技创新混合型证券投资基金
2021 年中期报告
2021 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商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	5
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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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	47
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	47
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	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	48
§8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
§9 开放式基金份额变动	49
§10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息	54
§12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通科技创新混合型证券投资基金	
基金简称	海富通科技创新混合	
基金主代码	009024	
交易代码	009024	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2020 年 3 月 10 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	281,874,637.54 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通科技创新混合 A	海富通科技创新混合 C
下属分级基金的交易代码	009025	009024
报告期末下属分级基金的份额总额	215,195,309.65 份	66,679,327.89 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将积极把握科技创新的发展趋势，聚焦于具有科技创新优势的行业和企业，充分把握其投资机会，在严格控制投资组合风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金为混合型基金，股票投资占基金资产的比例为 60%-95%，在进行资产配置决策时，在研究宏观经济基本面、政策面、市场情绪、资金面和投资者行为等多种因素的基础上，形成对不同市场周期的预测和判断，根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况，确定股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例。 科技创新是重塑经济增长动力的源泉。本基金将积极把握科技创新的发展趋势，聚焦于具有科技创新优势的行业和企业，充分把握其投资机会，在严格控制投资组合风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的收益。同时，结合行业配置策略、个股精选策略、港股投资策略、科创板股票的投资策略等进行投资。
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率×10%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险及预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金可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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	郭明
	联系电话	021-38650788	010-66105799
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95588
传真		021-33830166	010-66105798
注册地址		上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦 36-37层	北京市西城区复兴门内大街55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	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		杨仓兵	陈四清

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）	
	海富通科技创新混合 A	海富通科技创新混合 C
本期已实现收益	14,769,656.68	4,382,839.53
本期利润	5,389,565.30	2,336,289.73
加权平均基金份额本期利润	0.0199	0.0285
本期加权平均净值利润率	1.84%	2.67%

本期基金份额净值增长率	4.31%	3.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	海富通科技创新混合 A	海富通科技创新混合 C
期末可供分配利润	38,896,776.27	11,264,524.38
期末可供分配基金份额利润	0.1808	0.1689
期末基金资产净值	267,340,696.84	81,976,953.26
期末基金份额净值	1.2423	1.2294
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	海富通科技创新混合 A	海富通科技创新混合 C
基金份额累计净值增长率	24.23%	22.94%

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

海富通科技创新混合 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	14.71%	2.13%	3.25%	1.03%	11.46%	1.10%
过去三个月	21.76%	1.84%	13.91%	1.12%	7.85%	0.72%
过去六个月	4.31%	2.07%	9.48%	1.50%	-5.17%	0.57%
过去一年	18.49%	2.16%	31.28%	1.36%	-12.79%	0.80%
自基金合同生效起至今	24.23%	2.25%	50.01%	1.35%	-25.78%	0.90%

海富通科技创新混合 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	14.64%	2.13%	3.25%	1.03%	11.39%	1.10%
过去三个月	21.52%	1.83%	13.91%	1.12%	7.61%	0.71%
过去六个月	3.90%	2.07%	9.48%	1.50%	-5.58%	0.57%
过去一年	17.56%	2.16%	31.28%	1.36%	-13.72%	0.80%
自基金合同生效起至今	22.94%	2.25%	50.01%	1.35%	-27.07%	0.90%

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

海富通科技创新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 3 月 10 日至 2021 年 6 月 30 日)

海富通科技创新混合 A



海富通科技创新混合 C



注：本基金合同于 2020 年 3 月 10 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		
吕越超	本基金的基金经理；公募权益投资部副总监。	2020-03-10	-	10 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任长江证券研究所分析师，泰达宏利基金管理有限公司研究员、基金经理。2014 年 11 月至 2016 年 7 月任泰达宏利周期混合基金经理，2015 年 6 月至 2016 年 7 月兼任泰达宏利创益混合基金经理。2016 年 11 月起任海富通股票混合

					基金经理。2019 年 12 月起兼任海富通先进制造股票基金经理。2020 年 3 月起兼任海富通科技创新混合基金经理。2020 年 9 月起兼任海富通成长甄选混合基金经理。
杨宁嘉	本基金的基金经理助理。	2020-12-10	-	7 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任海通国际证券有限公司首席分析师助理、光大证券股份有限公司行业研究员。2017 年 5 月加入海富通基金管理有限公司，历任股票分析师、高级股票分析师。2020 年 12 月起任海富通成长甄选混合、海富通电子信息传媒产业股票、海富通股票混合、海富通国策导向混合、海富通科技创新混合、海富通先进制造股票、海富通中小盘混合基金经理助理。

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。

在上半年的操作中，本基金坚持自上而下的行业比较和自下而上的个股挖掘相结合，积极寻找成长股的投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期海富通科技创新混合 A 类份额净值增长率为 4.31%，同期基金业绩比较基准收益率为 9.48%，基金净值跑输业绩比较基准 5.17 个百分点；海富通科技创新混合 C 类份额净值增长率为 3.90%，同期基金业绩比较基准收益率为 9.48%，基金净值跑输业绩比较基准 5.58 个百分点，主要系报告期内军工板块跌幅较大，对基金净值产生了阶段性的影响。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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。

对于下半年，本基金将继续积极寻找优质成长股的投资机会，努力获取基金净值的良好表现。

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，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合规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对海富通科技创新混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，海富通科技创新混合型证券投资基金的管理人——海富通基金管理有限公司在海富通科技创新混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，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

本托管人依法对海富通基金管理有限公司编制和披露的海富通科技创新混合型证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：海富通科技创新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	23,459,365.78	45,500,881.03
结算备付金	6.4.10.6	1,710,387.15	996,405.29
存出保证金		149,193.60	253,130.17
交易性金融资产	6.4.7.2	326,210,104.84	514,933,505.24
其中：股票投资		326,210,104.84	514,933,505.24
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		6,225,965.97	12,143,518.06
应收利息	6.4.7.5	3,049.99	2,910.95
应收股利		-	-
应收申购款		471,230.94	1,205,937.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		358,229,298.27	575,036,287.84
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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		7,560,722.66	27,175,408.83
应付管理人报酬		413,861.27	704,750.55
应付托管费		68,976.90	117,458.43
应付销售服务费		54,273.51	69,684.37
应付交易费用	6.4.7.7	721,217.92	405,702.00
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	92,595.91	191,097.78
负债合计		8,911,648.17	28,664,101.96
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	281,874,637.54	459,301,124.89
未分配利润	6.4.7.10	67,443,012.56	87,071,060.99
所有者权益合计		349,317,650.10	546,372,185.88
负债和所有者权益总计		358,229,298.27	575,036,287.84

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 281,874,637.54 份。其中海富通科技创新混合 A 基金份额总额 215,195,309.65 份，基金份额净值 1.2423 元，海富通科技创新混合 C 基金份额总额 66,679,327.89 份，基金份额净值 1.2294 元。

6.2 利润表

会计主体：海富通科技创新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 3 月 10 日（基 金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		13,903,007.80	52,812,688.90
1.利息收入		55,195.19	281,929.56
其中：存款利息收入	6.4.7.11	55,195.19	281,929.56
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		24,739,401.55	-28,226,352.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	24,031,056.41	-29,757,646.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	708,345.14	1,531,293.99
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-11,426,641.18	80,609,260.83
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	535,052.24	147,851.05
减：二、费用		6,177,152.77	8,178,087.50
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,833,826.30	4,339,298.88
2. 托管费	6.4.10.2.2	472,304.40	723,216.50
3. 销售服务费		347,582.81	330,025.24
4. 交易费用	6.4.7.19	2,427,859.26	2,708,208.16
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	95,580.00	77,338.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,725,855.03	44,634,601.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,725,855.03	44,634,601.40

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通科技创新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）	459,301,124.89	87,071,060.99	546,372,185.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,725,855.03	7,725,855.03
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）	-177,426,487.35	-27,353,903.46	-204,780,390.81
其中：1.基金申购款	162,673,552.65	21,828,195.07	184,501,747.72
2.基金赎回款	-340,100,040.00	-49,182,098.53	-389,282,138.53
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）	281,874,637.54	67,443,012.56	349,317,650.10
项目	上年度可比期间 2020 年 3 月 10 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）	992,624,920.71	-	992,624,920.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	44,634,601.40	44,634,601.40
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）	-75,136,650.43	-584,315.17	-75,720,965.60
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-75,136,650.43	-584,315.17	-75,720,965.60
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）	917,488,270.28	44,050,286.23	961,538,556.51

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

海富通科技创新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]67 号文《关于准予海富通科技创新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《海富通科技创新混合型证券投资基金基金合同》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 992,624,920.71 元。经向中国证监会备案，《海富通科技创新混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 3 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 992,624,920.71 份基金份额。海富通科技创新混合 A 类基金份额 850,454,163.20 份，海富通科技创新混合 C 类基金份额 142,170,757.51 份。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《海富通科技创新混合型证券投资基金基金合同》和《海富通科技创新混合型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，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《海富通科技创新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、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（“港股通标的股票”）、存托凭证、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、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：股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 60%-95%，投资于科技创新主题相关的股票及存托凭证占非现金基金资产的比例不低于 80%，投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0-50%；每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者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、存出保证金和应收申购款等。法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律

法规适时合理地调整投资范围。本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率×10%+上证国债指数收益率×20%。

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 [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。

(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。

(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	23,459,365.78
定期存款	-
其他存款	-
合计	23,459,365.78

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	249,544,662.31	326,210,104.84	76,665,442.53

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		249,544,662.31	326,210,104.84	76,665,442.53

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有任何衍生金融资产 / 负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,296.78
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	692.73
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	60.48
合计	3,049.99

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	721,217.92
银行间市场应付交易费用	-
合计	721,217.92

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	3,335.76
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,260.15
合计	92,595.91

6.4.7.9 实收基金

海富通科技创新混合 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	374,603,964.28	374,603,964.28
本期申购	68,849,021.52	68,849,021.52
本期赎回（以“-”号填列）	-228,257,676.15	-228,257,676.15
本期末	215,195,309.65	215,195,309.65

海富通科技创新混合 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	84,697,160.61	84,697,160.61
本期申购	93,824,531.13	93,824,531.13
本期赎回（以“-”号填列）	-111,842,363.85	-111,842,363.85
本期末	66,679,327.89	66,679,327.89

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

海富通科技创新混合 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	43,050,894.70	28,494,963.87	71,545,858.57
本期利润	14,769,656.68	-9,380,091.38	5,389,565.30
本期基金份额交易产生的变动数	-18,923,775.11	-5,866,261.57	-24,790,036.68
其中：基金申购款	8,162,523.52	2,286,210.90	10,448,734.42
基金赎回款	-27,086,298.63	-8,152,472.47	-35,238,771.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	38,896,776.27	13,248,610.92	52,145,387.19

海富通科技创新混合 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	9,144,161.74	6,381,040.68	15,525,202.42
本期利润	4,382,839.53	-2,046,549.80	2,336,289.73
本期基金份额交易产生的变动数	-2,262,476.89	-301,389.89	-2,563,866.78
其中：基金申购款	10,435,440.88	944,019.77	11,379,460.65
基金赎回款	-12,697,917.77	-1,245,409.66	-13,943,327.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,264,524.38	4,033,100.99	15,297,625.37

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	45,427.21
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	8,454.68
其他	1,313.30

合计	55,195.19
----	-----------

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	1,017,543,668.71
减：卖出股票成本总额	993,512,612.30
买卖股票差价收入	24,031,056.41

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

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	708,345.14
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	708,345.14

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	-11,426,641.18
——股票投资	-11,426,641.18
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-11,426,641.18

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	533,462.83
转换费收入	1,589.41
合计	535,052.24

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	2,427,859.26
银行间市场交易费用	-
合计	2,427,859.26

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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	5,919.85
开户费	400.00
合计	95,580.00

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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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3月10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	385,665,294.16	21.11%	16,610,742.65	0.66%

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	274,325.53	22.34%	208,761.10	28.95%
关联方名称	上年度可比期间 2020年3月10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	11,815.30	0.71%	11,815.30	1.49%

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、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年3月10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	2,833,826.30	4,339,298.88
其中：支付销售机构的客户维护费	1,240,197.30	2,304,244.78

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 1.50%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 × 1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年3月10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	472,304.40	723,216.50

注：支付基金托管人中国工商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		
	海富通科技创新混合 A	海富通科技创新混合 C	合计
中国工商银行	-	34,932.20	34,932.20
海通证券	-	88,813.54	88,813.54
海富通	-	7.48	7.48
合计	-	123,753.22	123,753.22
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年3月10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		
	海富通科技创新混合 A	海富通科技创新混合 C	合计
中国工商银行	-	25,697.57	25,697.57
海通证券	-	191,980.31	191,980.31
海富通	-	399.35	399.35
合计	-	218,077.23	218,077.23

注：1、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 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

海富通科技创新混合 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 × 0.80% / 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3月10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
中国工商银行	23,459,365.78	45,427.21	69,791,445.80	263,644.07

注：本基金通过“中国工商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 1,710,387.15 元。（2020 年 6 月 30 日：人民币 1,969,568.36 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	公开发行	11,117	37,464.29
海通证券	688680	海优新材	公开发行	2,795	195,482.30
海通证券	300940	南极光	公开发行	3,068	39,147.68
海通证券	688687	凯因科技	公开发行	5,354	101,618.92
海通证券	688665	四方光电	公开发行	1,687	49,817.11
海通证券	688092	爱科科技	公开发行	1,137	21,728.07
海通证券	688626	翔宇医疗	公开发行	2,948	84,961.36
海通证券	688630	芯碁微装	公开发行	3,397	51,736.31
海通证券	688682	霍莱沃	公开发行	946	43,251.12
海通证券	300981	中红医疗	公开发行	2,659	129,200.81
海通证券	688217	睿昂基因	公开发行	1,040	19,156.80
上年度可比期间 2020 年 3 月 10 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
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股锁定	24.60	163.00	591	14,538.60	96,333.00	-
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	2021-07-21	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	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-

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	330	9,332.40	38,184.30	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股锁定	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	48.59	90.39	266	12,924.94	24,043.74	-
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	7,029	58,270.41	58,270.41	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股未上市并锁定	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股未上市并锁定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
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	-
688079	美迪凯	2021-02-23	2021-09-02	新股锁定	10.19	18.40	10,622	108,238.18	195,444.80	-
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	-
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	-
688269	凯立新材	2021-06-01	2021-12-09	新股锁定	18.94	100.92	1,941	36,762.54	195,885.72	-
688319	欧林生物	2021-05-31	2021-12-08	新股锁定	9.88	27.34	3,412	33,710.56	93,284.08	-
688328	深科达	2021-03-01	2021-09-09	新股锁定	16.49	37.79	1,499	24,718.51	56,647.21	-
688395	正弦电气	2021-04-21	2021-10-29	新股锁定	15.95	22.37	1,627	25,950.65	36,395.99	-
688601	力芯微	2021-06-18	2021-12-28	新股锁定	36.48	133.69	1,174	42,827.52	156,952.06	-
68862	呈和	2021-0	2021-1	新股	16.48	42.63	2,672	44,034	113,90	-

5	科技	5-31	2-07	锁定				.56	7.36	
688665	四方光电	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定	29.53	129.46	1,687	49,817.11	218,399.02	-
688677	海泰新光	2021-02-18	2021-08-26	新股锁定	35.76	103.23	1,768	63,223.68	182,510.64	-
688687	凯因科技	2021-01-29	2021-08-09	新股锁定	18.98	27.98	5,354	101,618.92	149,804.92	-

注：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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021-06-30	重大事项停牌	56.35	2021-07-01	59.49	149,700	7,899,315.29	8,435,595.00	-

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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

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，本基金未持有债券投资和资产支持证券(2020 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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上市公司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 3.01%。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	23,459,365.78	-	-	-	23,459,365.78
结算备付金	1,710,387.15	-	-	-	1,710,387.15
存出保证金	149,193.60	-	-	-	149,193.60
交易性金融资产	-	-	-	326,210,104.84	326,210,104.84
应收证券清算款	-	-	-	6,225,965.97	6,225,965.97
应收利息	-	-	-	3,049.99	3,049.99
应收申购款	-	-	-	471,230.94	471,230.94
资产总计	25,318,946.53	0.00	0.00	332,910,351.74	358,229,298.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,560,722.66	7,560,722.66
应付管理人报酬	-	-	-	413,861.27	413,861.27
应付托管费	-	-	-	68,976.90	68,976.90
应付销售服务费	-	-	-	54,273.51	54,273.51
应付交易费用	-	-	-	721,217.92	721,217.92
其他负债	-	-	-	92,595.91	92,595.91
负债总计	0.00	0.00	0.00	8,911,648.17	8,911,648.17
利率敏感度缺口	25,318,946.53	0.00	0.00	323,998,703.57	349,317,650.10
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	45,500,881.03	-	-	-	45,500,881.03
结算备付金	996,405.29	-	-	-	996,405.29
存出保证金	253,130.17	-	-	-	253,130.17
交易性金融资产	-	-	-	514,933,505.24	514,933,505.24
应收证券清算款	-	-	-	12,143,518.06	12,143,518.06
应收利息	-	-	-	2,910.95	2,910.95
应收申购款	-	-	-	1,205,937.10	1,205,937.10
资产总计	46,750,416.49	0.00	0.00	528,285,871.35	575,036,287.84

负债					
应付赎回款	-	-	-	27,175,408.83	27,175,408.83
应付管理人报酬	-	-	-	704,750.55	704,750.55
应付托管费	-	-	-	117,458.43	117,458.43
应付销售服务费	-	-	-	69,684.37	69,684.37
应付交易费用	-	-	-	405,702.00	405,702.00
其他负债	-	-	-	191,097.78	191,097.78
负债总计	0.00	0.00	0.00	28,664,101.96	28,664,101.96
利率敏感度缺口	46,750,416.49	0.00	0.00	499,621,769.39	546,372,185.88

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2020 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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。本基金投资组合中股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 60%-95%，投资于科技创新主题相关的股票及存托凭证占非现金基金资产的比例不低于 80%，投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0-50%。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	326,210,104.84	93.38	514,933,505.24	94.25
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	326,210,104.84	93.38	514,933,505.24	94.25

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)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%	17,695,747.57	32,594,102.37
	业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-17,695,747.57	-32,594,102.37

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	326,210,104.84	91.06
	其中：股票	326,210,104.84	91.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	25,169,752.93	7.03
8	其他各项资产	6,849,440.50	1.91
9	合计	358,229,298.27	100.00

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	32,707.58	0.01
B	采矿业	375,139.20	0.11
C	制造业	263,587,083.28	75.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,171,577.26	1.19
G	交通运输、仓储和邮政业	7,204,290.00	2.06

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,552,450.17	14.47
J	金融业	34,721.10	0.01
K	房地产业	10,095.90	0.00
L	租赁和商务服务业	15,994.06	0.00
M	科学研究和技术服务业	131,868.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	81,157.90	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	326,210,104.84	93.38

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	300671	富满电子	217,160	28,586,942.40	8.18
2	603026	石大胜华	155,300	25,166,365.00	7.20
3	000733	振华科技	361,600	22,082,912.00	6.32
4	605117	德业股份	125,800	16,052,080.00	4.60
5	002594	比亚迪	52,300	13,127,300.00	3.76
6	603678	火炬电子	163,600	11,043,000.00	3.16
7	300458	全志科技	120,800	10,589,328.00	3.03
8	002049	紫光国微	67,600	10,423,244.00	2.98
9	600399	抚顺特钢	564,250	10,235,495.00	2.93
10	688005	容百科技	82,096	9,950,035.20	2.85
11	603906	龙蟠科技	269,400	9,429,000.00	2.70
12	002459	晶澳科技	185,900	9,109,100.00	2.61
13	002340	格林美	955,400	8,932,990.00	2.56
14	601865	福莱特	223,600	8,838,908.00	2.53
15	600460	士兰微	149,700	8,435,595.00	2.41
16	300604	长川科技	118,600	8,089,706.00	2.32

17	688699	明微电子	25,778	7,354,978.96	2.11
18	002245	蔚蓝锂芯	365,700	7,204,290.00	2.06
19	300379	东方通	244,228	6,958,055.72	1.99
20	002371	北方华创	22,200	6,157,836.00	1.76
21	688626	翔宇医疗	48,563	5,868,352.92	1.68
22	002139	拓邦股份	305,800	5,501,342.00	1.57
23	002230	科大讯飞	79,500	5,372,610.00	1.54
24	002812	恩捷股份	21,100	4,939,510.00	1.41
25	002759	天际股份	118,600	4,405,990.00	1.26
26	300184	力源信息	594,300	3,779,748.00	1.08
27	603518	锦泓集团	136,000	3,356,480.00	0.96
28	300568	星源材质	76,616	3,169,603.92	0.91
29	600110	诺德股份	239,600	2,918,328.00	0.84
30	300726	宏达电子	41,100	2,897,139.00	0.83
31	002709	天赐材料	26,760	2,852,080.80	0.82
32	002185	华天科技	178,200	2,742,498.00	0.79
33	600171	上海贝岭	81,700	2,486,131.00	0.71
34	300750	宁德时代	4,300	2,299,640.00	0.66
35	688619	罗普特	80,652	2,217,930.00	0.63
36	000066	中国长城	137,600	2,008,960.00	0.58
37	300223	北京君正	16,700	1,685,364.00	0.48
38	002585	双星新材	80,200	1,614,426.00	0.46
39	300035	中科电气	65,800	1,608,810.00	0.46
40	688680	海优新材	5,511	1,416,327.00	0.41
41	601633	长城汽车	32,000	1,394,880.00	0.40
42	002241	歌尔股份	32,400	1,384,776.00	0.40
43	300593	新雷能	28,380	1,233,111.00	0.35
44	688598	金博股份	4,509	1,212,921.00	0.35
45	300114	中航电测	73,500	1,117,200.00	0.32
46	002335	科华数据	47,500	1,081,575.00	0.31
47	603986	兆易创新	5,720	1,074,788.00	0.31
48	688036	传音控股	5,015	1,050,642.50	0.30
49	002466	天齐锂业	16,800	1,041,936.00	0.30
50	002623	亚玛顿	23,700	1,002,273.00	0.29
51	300763	锦浪科技	5,440	982,464.00	0.28
52	300077	国民技术	59,400	949,212.00	0.27
53	300896	爱美客	1,176	927,722.88	0.27
54	688390	固德威	2,585	863,390.00	0.25
55	603799	华友钴业	6,700	765,140.00	0.22
56	688012	中微公司	4,138	686,576.96	0.20
57	688396	华润微	7,369	670,726.38	0.19
58	002407	多氟多	18,200	646,828.00	0.19
59	600812	华北制药	52,300	556,995.00	0.16
60	000301	东方盛虹	16,600	346,940.00	0.10

61	300274	阳光电源	2,900	333,674.00	0.10
62	601012	隆基股份	3,700	328,708.00	0.09
63	003022	联泓新科	10,400	319,280.00	0.09
64	002192	融捷股份	3,900	267,774.00	0.08
65	603267	鸿远电子	1,968	251,746.56	0.07
66	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.07
67	688161	威高骨科	2,334	247,520.70	0.07
68	688276	百克生物	2,359	246,704.22	0.07
69	688665	四方光电	1,687	218,399.02	0.06
70	688269	凯立新材	1,941	195,885.72	0.06
71	688079	美迪凯	10,622	195,444.80	0.06
72	688677	海泰新光	1,768	182,510.64	0.05
73	600703	三安光电	5,200	166,660.00	0.05
74	688700	东威科技	3,049	162,755.62	0.05
75	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.05
76	688601	力芯微	1,174	156,952.06	0.04
77	688687	凯因科技	5,354	149,804.92	0.04
78	688621	阳光诺和	1,485	131,868.00	0.04
79	002064	华峰化学	8,703	123,582.60	0.04
80	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.03
81	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.03
82	000983	山西焦煤	12,920	107,365.20	0.03
83	000062	深圳华强	5,900	99,769.00	0.03
84	300919	中伟股份	591	96,333.00	0.03
85	688319	欧林生物	3,412	93,284.08	0.03
86	688117	圣诺生物	1,672	80,924.80	0.02
87	688122	西部超导	1,114	72,265.18	0.02
88	688019	安集科技	213	66,243.00	0.02
89	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02
90	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.02
91	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
92	688585	上纬新材	4,922	52,173.20	0.01
93	688618	三旺通信	1,117	47,718.24	0.01
94	688679	通源环境	3,139	41,372.02	0.01
95	688517	金冠电气	2,892	41,095.32	0.01
96	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.01
97	300973	立高食品	330	38,184.30	0.01
98	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.01
99	688395	正弦电气	1,627	36,395.99	0.01
100	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.01
101	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
102	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
103	605296	神农集团	569	26,856.80	0.01
104	300981	中红医疗	266	24,043.74	0.01

105	603277	银都股份	1,000	23,250.00	0.01
106	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
107	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.01
108	300877	金春股份	569	20,922.13	0.01
109	001206	依依股份	321	20,389.92	0.01
110	300941	创识科技	399	19,926.06	0.01
111	300891	惠云钛业	1,143	19,876.77	0.01
112	603511	爱慕股份	553	18,249.00	0.01
113	300898	熊猫乳品	496	17,984.96	0.01
114	300864	南大环境	315	17,328.15	0.00
115	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
116	300908	仲景食品	285	16,983.15	0.00
117	300909	汇创达	386	16,636.60	0.00
118	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.00
119	300890	翔丰华	286	15,615.60	0.00
120	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
121	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
122	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
123	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
124	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
125	300892	品渥食品	272	12,479.36	0.00
126	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
127	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
128	300889	爱克股份	479	11,639.70	0.00
129	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
130	300876	蒙泰高新	350	11,567.50	0.00
131	300895	铜牛信息	339	11,529.39	0.00
132	300879	大叶股份	466	11,267.88	0.00
133	300782	卓胜微	20	10,750.00	0.00
134	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
135	605259	绿田机械	295	10,516.75	0.00
136	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
137	605189	富春染织	422	10,165.98	0.00
138	300917	特发服务	365	10,095.90	0.00
139	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
140	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
141	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
142	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
143	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
144	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
145	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
146	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
147	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
148	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00

149	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
150	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
151	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
152	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
153	300014	亿纬锂能	71	7,379.03	0.00
154	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
155	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
156	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
157	600882	妙可蓝多	93	6,491.40	0.00
158	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
159	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
160	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
161	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
162	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
163	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
164	300995	奇德新材	209	5,008.52	0.00
165	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
166	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
167	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
168	600582	天地科技	400	1,560.00	0.00

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	603026	石大胜华	28,505,463.08	5.22
2	300726	宏达电子	20,981,273.98	3.84
3	300598	诚迈科技	20,061,982.00	3.67
4	603799	华友钴业	16,680,625.00	3.05
5	601699	潞安环能	16,494,030.70	3.02
6	600188	兖州煤业	16,379,843.70	3.00
7	002759	天际股份	16,329,652.00	2.99
8	002340	格林美	15,695,707.00	2.87
9	000807	云铝股份	15,390,595.14	2.82
10	002594	比亚迪	15,352,817.52	2.81
11	002185	华天科技	13,955,091.36	2.55
12	600997	开滦股份	13,844,715.00	2.53
13	300671	富满电子	13,842,802.57	2.53
14	300601	康泰生物	13,367,223.86	2.45
15	605117	德业股份	12,702,720.98	2.32

16	603906	龙蟠科技	11,850,744.92	2.17
17	002466	天齐锂业	11,586,160.78	2.12
18	600483	福能股份	11,080,935.92	2.03
19	300379	东方通	10,785,710.68	1.97
20	603987	康德莱	10,756,459.24	1.97

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	603267	鸿远电子	57,564,317.21	10.54
2	300379	东方通	54,981,797.65	10.06
3	300659	中孚信息	49,958,810.90	9.14
4	300598	诚迈科技	46,824,414.96	8.57
5	688111	金山办公	43,116,516.05	7.89
6	000733	振华科技	42,476,184.67	7.77
7	603678	火炬电子	33,545,983.72	6.14
8	688122	西部超导	27,833,200.34	5.09
9	600399	抚顺特钢	26,600,400.75	4.87
10	300726	宏达电子	23,605,130.81	4.32
11	002049	紫光国微	21,006,392.30	3.84
12	603026	石大胜华	18,684,024.80	3.42
13	603799	华友钴业	17,977,244.00	3.29
14	600997	开滦股份	15,832,497.00	2.90
15	000066	中国长城	15,706,239.80	2.87
16	603987	康德莱	15,324,476.00	2.80
17	601699	潞安环能	14,877,927.00	2.72
18	300014	亿纬锂能	14,814,877.33	2.71
19	600188	兖州煤业	14,649,197.25	2.68
20	000807	云铝股份	13,829,266.40	2.53
21	300601	康泰生物	13,215,204.82	2.42
22	600483	福能股份	11,503,546.45	2.11

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	816,215,853.08
卖出股票的收入（成交）总额	1,017,543,668.71

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

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，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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	149,193.60
2	应收证券清算款	6,225,965.97
3	应收股利	-
4	应收利息	3,049.99
5	应收申购款	471,230.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,849,440.50

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 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	户均持有的	持有人结构
------	------	-------	-------

	数(户)	基金份额	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
海富通科技创新混合 A	12,170	17,682.44	334,709.97	0.16%	214,860,599.68	99.84%
海富通科技创新混合 C	8,098	8,234.05	1,081,838.50	1.62%	65,597,489.39	98.38%
合计	20,268	13,907.37	1,416,548.47	0.50%	280,458,089.07	99.50%

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	海富通科技创新混合 A	20,982.53	0.0098%
	海富通科技创新混合 C	13,312.03	0.0200%
	合计	34,294.56	0.0122%

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	海富通科技创新混合 A	0
	海富通科技创新混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通科技创新混合 A	0
	海富通科技创新混合 C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通科技创新混合 A	海富通科技创新混合 C
基金合同生效日（2020 年 3 月 10 日）基金份额总额	850,454,163.20	142,170,757.51
本报告期期初基金份额总额	374,603,964.28	84,697,160.61
本报告期基金总申购份额	68,849,021.52	93,824,531.13
减：本报告期基金总赎回份额	228,257,676.15	111,842,363.85
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	215,195,309.65	66,679,327.89

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

1、报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

2、报告期内，本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据工作需要，任命刘彤女士担任公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。李勇先生不再担任公司资产托管部总经理职务。

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	1	385,665,294.16	21.11%	274,325.53	22.34%	-
申万宏源	2	294,739,628.59	16.13%	124,386.68	10.13%	-
东吴证券	2	269,452,510.63	14.75%	196,121.88	15.97%	-
方正证券	1	235,582,555.60	12.89%	167,570.11	13.65%	-
长江证券	2	204,163,920.45	11.17%	145,356.57	11.84%	-
中泰证券(原齐鲁)	2	183,100,368.11	10.02%	133,897.58	10.91%	-

民生证券	1	82,682,703.66	4.53%	60,464.06	4.93%	-
东兴证券	2	79,202,843.29	4.33%	57,920.47	4.72%	-
华泰证券	1	50,143,773.68	2.74%	36,669.54	2.99%	-
中信证券	2	38,873,267.81	2.13%	28,429.79	2.32%	-
东方证券	1	3,476,768.57	0.19%	2,542.99	0.21%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期新增中信证券 2 个交易单元，长江证券 2 个交易单元，民生证券 1 个交易单元。

2、(1)交易单元的选择标准

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

(2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	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	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券(原齐鲁)	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

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中国银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	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
3	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加平安银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	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
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
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	2021-01-29
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	2021-02-02
9	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
10	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
11	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东吴证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	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	2021-03-05
12	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	2021-03-16

	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	
13	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
14	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
15	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
16	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
17	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
18	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
19	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
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	2021-04-15
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	2021-06-28
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科技创新混合型证券投资基金的文件
- （二）海富通科技创新混合型证券投资基金基金合同
- （三）海富通科技创新混合型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通科技创新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它文件

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