

# 海富通欣睿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：恒丰银行股份有限公司

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。

基金托管人恒丰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 2 月 9 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 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.....	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.....	11
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.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告</b> .....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55

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 .....	55
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	55
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	55
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
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 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
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 .....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.8 其他重大事件 .....	57
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	57
<b>§12 备查文件目录</b> .....	59
12.1 备查文件目录 .....	59
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	59

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通欣睿混合型证券投资基金	
基金简称	海富通欣睿混合	
基金主代码	010657	
交易代码	010657	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2021 年 2 月 9 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	恒丰银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	207,973,678.20 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通欣睿混合 A	海富通欣睿混合 C
下属分级基金的交易代码	010657	010658
报告期末下属分级基金的份额总额	50,116,637.28 份	157,857,040.92 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极主动的资产配置与严谨的风险管理，在严格控制风险的前提下，积极把握证券市场的投资机会，追求资产的保值增值。
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，确定基金资产在股票、债券、货币市场工具之间的配置比例。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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×20%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%+中证全债指数收益率×75%。
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	恒丰银行股份有限公司
信息披露	姓名	岳冲	王丹
	联系电话	021-38650788	021-63890697

负责人	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	wangdan@hfbank.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95395
传真		021-33830166	021-63890708
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	山东省济南市历下区泺源大街 8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	上海市黄浦区开平路88号瀛通 绿地大厦16楼
邮政编码		200120	200023
法定代表人		杨仓兵	陈颖

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 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2月9日(基金合同生效日)至2021年6月30日)	
	海富通欣睿混合 A	海富通欣睿混合 C
本期已实现收益	974,288.64	3,377,863.15
本期利润	510,334.09	1,337,342.34
加权平均基金份额本期利润	0.0122	0.0079
本期加权平均净值利润率	1.22%	0.79%
本期基金份额净值增长率	1.27%	1.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
	海富通欣睿混合 A	海富通欣睿混合 C

期末可供分配利润	638,825.05	1,886,474.23
期末可供分配基金份额利润	0.0127	0.0120
期末基金资产净值	50,755,462.33	159,743,515.15
期末基金份额净值	1.0127	1.0120
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2021年6月30日)</b>	
	海富通欣睿混合 A	海富通欣睿混合 C
基金份额累计净值增长率	1.27%	1.20%

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）。

4、本基金合同生效日为 2021 年 2 月 9 日，合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

### 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

海富通欣睿混合 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	0.69%	0.18%	-0.25%	0.19%	0.94%	-0.01%
过去三个月	2.12%	0.21%	1.73%	0.22%	0.39%	-0.01%
自基金合同生效起至今	1.27%	0.26%	0.33%	0.30%	0.94%	-0.04%

海富通欣睿混合 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	0.68%	0.18%	-0.25%	0.19%	0.93%	-0.01%
过去三个月	2.08%	0.21%	1.73%	0.22%	0.35%	-0.01%
自基金合同生效起至今	1.20%	0.26%	0.33%	0.30%	0.87%	-0.04%

#### 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

海富通欣睿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

第 7 页共 59 页

(2021 年 2 月 9 日至 2021 年 6 月 30 日)

## 海富通欣睿混合 A



## 海富通欣睿混合 C



注：1、本基金合同于 2021 年 2 月 9 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、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。截止本报告期末，本基金尚处于建仓期。

## §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		
江勇	本基金的基金经理	2021-02-09	-	10 年	经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任国泰君安期货有限公司研究所高级分析师，资产管理部研究员、交易员、投资经理。2017 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2018 年 7 月起任海富通上证周期 ETF、海富通上证周期 ETF 联接、海富通上证非周期 ETF、海富通上证非周期 ETF 联接、海富通中证 100 指数(LOF)基金经理。2018 年 7 月至 2020 年 3 月任海富通中证内地低碳指数(现海富通中证 500 增强)基金经理。2020 年 8 月起兼任海富通中证长三角

					领先 ETF、海富通中证长三角领先 ETF 联接基金经理。2020 年 10 月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2021 年 2 月起兼任海富通欣睿混合基金经理。2021 年 6 月起兼任海富通中证港股通科技 ETF 和海富通策略收益债券基金经理。
--	--	--	--	--	---

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。

债券市场，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 12.7p。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债“红橙黄绿”的多重限制，上半年信用债供给缩量，供需因而产生错配，小型资产荒渐显，二级市场信用债收益率整体逐步下行。可转债方面，上半年中证转债指数上涨 4.0%。分类型来看，股性转债（转股价值大于 130 元）表现较好，平均累计涨幅达到 50.8%；中等市值券（100 亿至 300 亿）表现次好，平均涨幅达到 15.3%。行业方面，多数行业取得正收益，其中成长板块表现尤为突出。

报告期间，本基金在控制回撤的基础上，积极寻找合适的股票以赚取绝对收益，行业分布上较

为均衡；同时，本基金积极参与新股申购以增强投资收益。债券方面配置以绝对收益角度出发，主要配置中短久期、高评级的信用债及存单；同时配置了部分绝对价格较低的转债，以期增厚债券部分收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 份额净值增长率为 1.27%，同期业绩比较基准收益率为 0.33%；本基金 C 份额净值增长率为 1.20%，同期业绩比较基准收益率为 0.33%。

#### 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。

未来，本基金将继续在控制风险的基础上，积极寻找市场的结构性机会，力争跑赢市场。同时，基金依然会参与新股申购，努力增厚收益；本基金也将利用动态的仓位调整或者股指期货套保等风险管理工具来控制回撤风险。固定收益部分，仍以持有高等级信用债为主，同时将视市场状况配置一定比例的具备绝对收益的转债，以增厚组合收益。

#### 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遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支、利润分配情况等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、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，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：海富通欣睿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
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	1,088,665.72
结算备付金		2,173,380.46
存出保证金		1,433,198.99
交易性金融资产	6.4.7.2	233,447,025.13
其中：股票投资		63,950,729.53
基金投资		-
债券投资		169,496,295.60
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		-
应收利息	6.4.7.5	1,540,136.13
应收股利		-
应收申购款		440.00
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		239,682,846.43
<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>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		25,600,000.00
应付证券清算款		271,060.93
应付赎回款		3,042,297.13
应付管理人报酬		105,542.62
应付托管费		17,590.46
应付销售服务费		26,899.44
应付交易费用	6.4.7.7	43,184.95
应交税费		7,601.12
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	69,692.30
负债合计		29,183,868.95
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	207,973,678.20
未分配利润	6.4.7.10	2,525,299.28

所有者权益合计		210,498,977.48
负债和所有者权益总计		239,682,846.43

注：1、报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 207,973,678.20 份，其中海富通欣睿 A 类份额 50,116,637.28 份，海富通欣睿 C 类份额 157,857,040.92 份。A 类份额净值 1.0127 元，C 类份额净值 1.0120 元。

2、基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

## 6.2 利润表

会计主体：海富通欣睿混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>2,838,647.23</b>
1.利息收入		1,753,681.09
其中：存款利息收入	6.4.7.11	80,413.12
债券利息收入		1,610,562.37
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		62,705.60
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,564,330.02
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,303,652.19
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	358,301.00
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	18,174.76
股利收益	6.4.7.16	884,202.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,504,475.36
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	25,111.48
<b>减：二、费用</b>		<b>990,970.80</b>
1. 管理人报酬		490,472.39
2. 托管费		81,745.38
3. 销售服务费		131,291.13
4. 交易费用	6.4.7.19	165,267.92
5. 利息支出		43,796.09

其中：卖出回购金融资产支出		43,796.09
6.税金及附加		5,286.58
7.其他费用	6.4.7.20	73,111.31
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,847,676.43</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,847,676.43</b>

注：财务报表的实际编制期间为 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日，上年度可比期间无比较数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通欣睿混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）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）	240,706,831.26	-	240,706,831.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,847,676.43	1,847,676.43
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）	-32,733,153.06	677,622.85	-32,055,530.21
其中：1.基金申购款	88,417,484.64	-227,856.83	88,189,627.81
2.基金赎回款	-121,150,637.70	905,479.68	-120,245,158.02
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）	207,973,678.20	2,525,299.28	210,498,977.48

注：基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

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

海富通欣睿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] 2849 号《关于准予海富通欣睿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《海富通欣睿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 240,695,796.69 元。经向中国证监会备案,《海富通欣睿混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 2 月 9 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 240,706,831.26 份基金份额,其中认购资金利息折合 11,034.57 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,基金托管人为恒丰银行股份有限公司。

根据《海富通欣睿混合型证券投资基金基金合同》和《海富通欣睿混合型证券投资基金招募说明书》,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《海富通欣睿混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金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、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、国债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。如法律法规或监管机构以后允许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。

本基金投资于股票资产的比例占基金资产的比例为 0%-50%,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、国债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。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×20%+恒生指数收益率(经汇率调整)×5%+中证全债指数收益率×75%。

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

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表以衍生金融资产列示外, 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表以交易性金融资产列

示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该

限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **6.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、

财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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:

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

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

(2)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。

(3)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。

(4)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。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	1,088,665.72
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,088,665.72

#### 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	66,466,956.24	63,950,729.53	-2,516,226.71	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	140,045,774.25	140,348,295.60	302,521.35
	银行间市场	29,155,570.00	29,148,000.00	-7,570.00
	合计	169,201,344.25	169,496,295.60	294,951.35
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	235,668,300.49	233,447,025.13	-2,221,275.36	

#### 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	-10,609,260.00	-	-	-
——股指期货	-10,609,260.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-10,609,260.00	-	-	-

注：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-1,549,920.00 元，公允价值变动-64,440.00 元。持有卖出 IH2109 合约市值-9,342,540.00 元，公允价值变动-218,760.00 元。

衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0 元。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0 元。

**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	133.60
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	1,088.90
应收债券利息	1,538,856.83
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	56.80
合计	1,540,136.13

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末其他资产无余额。

**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	42,834.95
银行间市场应付交易费用	350.00
合计	43,184.95

**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	0.12
应付证券出借违约金	-
预提费用	69,692.18
合计	69,692.30

#### 6.4.7.9 实收基金

海富通欣睿混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	40,225,542.01	40,225,542.01
本期申购	19,910,334.44	19,910,334.44
本期赎回（以“-”号填列）	-10,019,239.17	-10,019,239.17
本期末	50,116,637.28	50,116,637.28

海富通欣睿混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	200,481,289.25	200,481,289.25
本期申购	68,507,150.20	68,507,150.20
本期赎回（以“-”号填列）	-111,131,398.53	-111,131,398.53
本期末	157,857,040.92	157,857,040.92

注：1、本基金自 2020 年 12 月 21 日至 2021 年 2 月 5 日期间公开发售，共募集有效净认购资金 240,695,796.69 元，折合为 240,695,796.69 份海富通欣睿混合型证券投资基金基金份额，其中 A 类基金份额 40,223,538.94 份，C 类基金份额 200,472,257.75 份。根据《海富通欣睿混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 11,034.57 元在本基金成立后，折算为 11,034.57 份基金份额（A 类基金份额为 2,003.07 份，C 类基金份额为 9,031.50 份），划入基金份额持有人账户。

2、根据《海富通欣睿混合型证券投资基金招募说明书》、《海富通欣睿混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告》相关规定，本基金于 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 3 月 10 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购、赎回、转换、定投业务自 2021 年 3 月 11 日起开始办理。

3、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

海富通欣睿混合 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
本期利润	974,288.64	-463,954.55	510,334.09
本期基金份额交易产生的变动数	113,730.14	14,760.82	128,490.96
其中：基金申购款	199,082.11	-109,698.86	89,383.25
基金赎回款	-85,351.97	124,459.68	39,107.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,088,018.78	-449,193.73	638,825.05

海富通欣睿混合 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
本期利润	3,377,863.15	-2,040,520.81	1,337,342.34
本期基金份额交易产生的变动数	-76,469.83	625,601.72	549,131.89
其中：基金申购款	321,810.45	-639,050.53	-317,240.08
基金赎回款	-398,280.28	1,264,652.25	866,371.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,301,393.32	-1,414,919.09	1,886,474.23

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	61,407.18
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	14,356.27
其他	4,649.67
合计	80,413.12

**6.4.7.12 股票投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
卖出股票成交总额	40,198,668.51
减：卖出股票成本总额	37,895,016.32
买卖股票差价收入	2,303,652.19

**6.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年2月9日（基金合同生效日）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	57,406,622.66
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	56,461,614.49
减：应收利息总额	586,707.17
买卖债券差价收入	358,301.00

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股指期货投资收益	18,720.00
股指期货差价收入应缴纳增值税额	-545.24
合计	18,174.76

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	884,202.07
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	884,202.07

## 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2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-2,221,275.36
——股票投资	-2,516,226.71
——债券投资	294,951.35
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-283,200.00
——权证投资	-
——股指期货	-283,200.00
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	-2,504,475.36

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
基金赎回费收入	25,111.48
合计	25,111.48

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
交易所市场交易费用	164,917.92
银行间市场交易费用	350.00
合计	165,267.92

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
审计费用	21,778.54

信息披露费	47,913.64
证券出借违约金	-
证券组合费	3.43
银行划款手续费	3,015.70
开户费	400.00
合计	73,111.31

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
恒丰银行股份有限公司(“恒丰银行”)	基金托管人
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东

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

本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行股票交易，基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行权证交易，基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

**6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期间无应支付关联方的佣金，基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

**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2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	490,472.39
其中：支付销售机构的客户维护费	338.43

注：1、支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.60% ÷ 当年天数。

2、基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	81,745.38

注：1、支付基金托管人恒丰银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% ÷ 当年天数。

2、基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

**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2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通欣睿混合 A	海富通欣睿混合 C	合计
恒丰银行	-	-	-
海通证券	-	-	-
海富通基金	-	131,232.88	131,232.88
合计	-	131,232.88	131,232.88

注：1、本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的基金销售服务费年费率为 0.20%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.20% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。销售服务费的计算方法如下：日销售服务费 = 前一日 C 类份额的基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

2、基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易，基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

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

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

本基金本报告期末发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务，基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

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

本基金本报告期末发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务，基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	海富通欣睿混合A	海富通欣睿混合C
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	19,863,495.40	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	19,863,495.40	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	9.55%	-

注：1、此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

2、本基金管理人运用自有资金总计 19,952,881.13 元转换入本基金，其中，补差手续费为 1,000 元，符合招募说明书中规定的申购费率。

3、基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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

海富通欣睿混合 C

份额单位：份

关联方名称	海富通欣睿混合C本期末 2021年6月30日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
恒丰银行	50,002,250.00	24.04%

注：基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
恒丰银行	1,088,665.72	61,407.18

注：基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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2月9日（基金合同生效日）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	688217	睿昂基因	网下发行	1,040	19,156.80

注：基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项，基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

## 6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
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	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,073	45,523.08	45,523.08	-
688117	圣诺生物	2021-05-26	2021-12-03	新股锁定流通受限	17.90	35.97	1,672	29,928.80	60,141.84	-
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	-
688700	东威科技	2021-06-07	2021-12-15	新股锁定流通受限	9.41	38.46	3,049	28,691.09	117,264.54	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021-06-17	2021-07-01	新债未上市	100.00	100.00	1,830	183,000.00	183,000.00	-
113626	伯特转债	2021-06-29	2021-07-21	老股东配债	100.00	100.00	170	17,000.00	17,000.00	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基

金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 25,600,000.00 元，截至 2021 年 7 月 1 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

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。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 75.35%。基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

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
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	10,103,371.20
合计	10,103,371.20

注：1、未评级部分为国债。

2、基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

##### 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

A-1	-
A-1 以下	-
未评级	29,148,000.00
合计	29,148,000.00

#### 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
AAA	121,576,180.00
AAA 以下	7,893,705.60
未评级	775,038.80
合计	130,244,924.40

注：1、未评级部分为政策性金融债。

2、基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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，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%，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。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.21%。

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	1,088,665.72	-	-	-	1,088,665.72
结算备付金	2,173,380.46	-	-	-	2,173,380.46
存出保证金	1,433,198.99	-	-	-	1,433,198.99
交易性金融资产	100,218,490.20	66,957,280.80	2,320,524.60	63,950,729.53	233,447,025.13
应收申购款	-	-	-	440.00	440.00
应收利息	-	-	-	1,540,136.13	1,540,136.13
资产总计	104,913,735.37	66,957,280.80	2,320,524.60	65,491,305.66	239,682,846.43
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	25,600,000.00	25,600,000.00
应付证券清算款	-	-	-	271,060.93	271,060.93
应付管理人报酬	-	-	-	105,542.62	105,542.62
应付托管费	-	-	-	17,590.46	17,590.46
应付销售服务费	-	-	-	26,899.44	26,899.44
应付交易费用	-	-	-	43,184.95	43,184.95
应交税费	-	-	-	7,601.12	7,601.12
应付赎回款	-	-	-	3,042,297.13	3,042,297.13
其他负债	-	-	-	69,692.30	69,692.30
负债总计	-	-	-	29,183,868.95	29,183,868.95
利率敏感度缺口	104,913,735.37	66,957,280.80	2,320,524.60	36,307,436.71	210,498,977.48

注：1、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。

2、基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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
	市场利率上升 25 个基点	-583,473.03
	市场利率下降 25 个基点	588,029.82

注：基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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			
沪港通股票	-	329,095.96	329,095.96
深港通股票	-	82,625.54	82,625.54
资产合计	-	411,721.50	411,721.50
以外币计价的 负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净	-	411,721.50	411,721.50

额			
---	--	--	--

注：基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2021 年 6 月 30 日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	20,586.08
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-20,586.08	

注：基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	63,950,729.53	30.38

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	-	-
<b>合计</b>	<b>63,950,729.53</b>	<b>30.38</b>

注：基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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
	业绩比较基准（附注 6.4.1）上升 5%	1,970,095.60
	业绩比较基准（附注 6.4.1）下降 5%	-1,970,095.60

注：基金合同成立于 2021 年 2 月 9 日，上年度可比期间无比较数据。

#### 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	63,950,729.53	26.68
	其中：股票	63,950,729.53	26.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	169,496,295.60	70.72
	其中：债券	169,496,295.60	70.72
	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	3,262,046.18	1.36
8	其他各项资产	2,973,775.12	1.24
9	合计	239,682,846.43	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 329,095.96 元，占资产净值比例为 0.16%；

本基金通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 82,625.54 元，占资产净值比例为 0.04%。

## 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	-	-
B	采矿业	3,757,880.00	1.79
C	制造业	31,999,797.64	15.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,643,677.39	2.68
E	建筑业	1,393,499.00	0.66
F	批发和零售业	1,331,194.30	0.63
G	交通运输、仓储和邮政业	1,098,600.00	0.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,173,106.60	1.03
J	金融业	12,776,610.10	6.07
K	房地产业	1,211,426.00	0.58
L	租赁和商务服务业	1,300,360.00	0.62
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	592,515.00	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	159,770.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	100,572.00	0.05

S	综合	-	-
	合计	63,539,008.03	30.18

### 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	82,625.54	0.04
金融	86,128.60	0.04
通信服务	242,967.36	0.12
合计	411,721.50	0.20

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	601288	农业银行	862,500	2,613,375.00	1.24
2	600887	伊利股份	64,600	2,379,218.00	1.13
3	600900	长江电力	102,700	2,119,728.00	1.01
4	600036	招商银行	36,800	1,994,192.00	0.95
5	601328	交通银行	331,400	1,623,860.00	0.77
6	600309	万华化学	14,400	1,567,008.00	0.74
7	601166	兴业银行	70,100	1,440,555.00	0.68
8	600519	贵州茅台	700	1,439,690.00	0.68
9	600406	国电南瑞	53,760	1,249,382.40	0.59
10	600176	中国巨石	77,495	1,201,947.45	0.57
11	600031	三一重工	41,000	1,191,870.00	0.57
12	601966	玲珑轮胎	25,600	1,119,744.00	0.53
13	601139	深圳燃气	164,200	1,077,152.00	0.51
14	601398	工商银行	204,900	1,059,333.00	0.50
15	600958	东方证券	105,200	1,050,948.00	0.50
16	601877	正泰电器	30,600	1,021,428.00	0.49
17	601818	光大银行	242,100	915,138.00	0.43
18	600285	羚锐制药	85,200	894,600.00	0.42
19	600803	新奥股份	53,500	883,285.00	0.42
20	600276	恒瑞医药	12,720	864,578.40	0.41
21	600461	洪城环境	114,900	834,174.00	0.40
22	600028	中国石化	190,500	830,580.00	0.39
23	600690	海尔智家	30,300	785,073.00	0.37
24	600196	复星医药	10,500	757,365.00	0.36

25	601225	陕西煤业	61,900	733,515.00	0.35
26	601799	星宇股份	2,900	654,588.00	0.31
27	601012	隆基股份	7,300	648,532.00	0.31
28	601009	南京银行	60,900	640,668.00	0.30
29	600486	扬农化工	5,700	637,089.00	0.30
30	600885	宏发股份	9,900	620,730.00	0.29
31	600479	千金药业	69,100	614,990.00	0.29
32	601318	中国平安	9,500	610,660.00	0.29
33	600383	金地集团	59,200	606,208.00	0.29
34	600018	上港集团	125,200	597,204.00	0.28
35	601390	中国中铁	108,100	566,444.00	0.27
36	600298	安琪酵母	10,400	565,552.00	0.27
37	600057	厦门象屿	83,000	518,750.00	0.25
38	603658	安图生物	6,840	518,266.80	0.25
39	601006	大秦铁路	76,200	501,396.00	0.24
40	600426	华鲁恒升	15,290	473,225.50	0.22
41	600438	通威股份	10,800	467,316.00	0.22
42	601336	新华保险	10,000	459,100.00	0.22
43	601857	中国石油	86,400	457,056.00	0.22
44	600570	恒生电子	4,900	456,925.00	0.22
45	600138	中青旅	43,000	451,500.00	0.21
46	601618	中国中冶	150,000	447,000.00	0.21
47	600380	健康元	31,200	428,376.00	0.20
48	603678	火炬电子	6,000	405,000.00	0.19
49	600323	瀚蓝环境	18,500	403,115.00	0.19
50	603811	诚意药业	23,227	402,988.45	0.19
51	688089	嘉必优	8,646	396,851.40	0.19
52	601001	晋控煤业	54,400	394,944.00	0.19
53	603369	今世缘	7,200	389,952.00	0.19
54	603218	日月股份	13,800	373,704.00	0.18
55	603589	口子窖	5,500	372,295.00	0.18
56	600674	川投能源	29,700	366,201.00	0.17
57	601088	中国神华	18,700	365,024.00	0.17
58	603348	文灿股份	9,900	346,500.00	0.16
59	601888	中国中免	1,100	330,110.00	0.16
60	601668	中国建筑	69,700	324,105.00	0.15
61	600161	天坛生物	9,400	321,950.00	0.15
62	600048	保利地产	26,200	315,448.00	0.15
63	603416	信捷电气	4,900	311,003.00	0.15
64	600729	重庆百货	11,300	310,185.00	0.15
65	600521	华海药业	14,800	309,024.00	0.15
66	601233	桐昆股份	12,400	298,716.00	0.14
67	603601	再升科技	25,800	298,506.00	0.14
68	603727	博迈科	16,100	293,342.00	0.14

69	600985	淮北矿业	24,000	293,040.00	0.14
70	600998	九州通	19,000	292,030.00	0.14
71	603501	韦尔股份	900	289,800.00	0.14
72	601808	中海油服	20,000	287,200.00	0.14
73	603279	景津环保	12,400	274,784.00	0.13
74	603596	伯特利	7,500	268,125.00	0.13
75	600873	梅花生物	45,900	257,040.00	0.12
76	600872	中炬高新	6,000	252,120.00	0.12
77	688526	科前生物	6,918	250,569.96	0.12
78	600183	生益科技	10,600	248,146.00	0.12
79	603233	大参林	4,800	245,328.00	0.12
80	00700	腾讯控股	500	242,967.36	0.12
81	603866	桃李面包	7,700	240,240.00	0.11
82	002727	一心堂	7,200	238,392.00	0.11
83	600038	中直股份	4,500	237,330.00	0.11
84	600332	白云山	6,900	233,565.00	0.11
85	603987	康德莱	8,800	228,800.00	0.11
86	603303	得邦照明	14,200	223,650.00	0.11
87	600219	南山铝业	60,000	216,000.00	0.10
88	600703	三安光电	6,500	208,325.00	0.10
89	002531	天顺风能	24,000	207,600.00	0.10
90	600062	华润双鹤	16,800	200,088.00	0.10
91	603611	诺力股份	14,300	198,913.00	0.09
92	600886	国投电力	20,300	195,083.00	0.09
93	600745	闻泰科技	2,000	193,800.00	0.09
94	600845	宝信软件	3,770	191,893.00	0.09
95	601827	三峰环境	20,000	189,400.00	0.09
96	601998	中信银行	37,100	189,210.00	0.09
97	603899	晨光文具	2,200	186,032.00	0.09
98	603816	顾家家居	2,400	185,472.00	0.09
99	688366	昊海生科	884	185,021.20	0.09
100	603368	柳药股份	9,100	179,634.00	0.09
101	603267	鸿远电子	1,400	179,088.00	0.09
102	601689	拓普集团	4,700	175,921.00	0.08
103	601231	环旭电子	10,400	174,824.00	0.08
104	603786	科博达	2,300	173,650.00	0.08
105	600741	华域汽车	6,600	173,382.00	0.08
106	601952	苏垦农发	16,600	172,308.00	0.08
107	688099	晶晨股份	1,479	165,943.80	0.08
108	603181	皇马科技	9,450	163,201.50	0.08
109	603882	金城医学	1,000	159,770.00	0.08
110	688161	威高骨科	1,495	158,544.75	0.08
111	688002	睿创微纳	1,557	155,435.31	0.07
112	601158	重庆水务	29,700	155,034.00	0.07

113	600967	内蒙一机	15,000	151,800.00	0.07
114	600639	浦东金桥	10,700	146,055.00	0.07
115	601601	中国太保	5,000	144,850.00	0.07
116	002968	新大正	3,300	143,715.00	0.07
117	600166	福田汽车	40,000	138,000.00	0.07
118	603806	福斯特	1,200	126,156.00	0.06
119	601100	恒立液压	1,400	120,288.00	0.06
120	688700	东威科技	3,049	117,264.54	0.06
121	300577	开润股份	5,000	107,150.00	0.05
122	601717	郑煤机	9,200	106,996.00	0.05
123	600522	中天科技	10,400	104,000.00	0.05
124	603186	华正新材	2,800	102,088.00	0.05
125	603187	海容冷链	2,380	102,054.40	0.05
126	600507	方大特钢	14,900	101,022.00	0.05
127	600373	中文传媒	10,200	100,572.00	0.05
128	002539	云图控股	11,400	99,522.00	0.05
129	002381	双箭股份	12,000	98,640.00	0.05
130	300259	新天科技	21,600	98,280.00	0.05
131	603298	杭叉集团	4,800	87,072.00	0.04
132	600584	长电科技	2,300	86,664.00	0.04
133	06066	中信建投证券	11,000	86,128.60	0.04
134	00826	天工国际	30,000	82,625.54	0.04
135	601899	紫金矿业	8,300	80,427.00	0.04
136	688109	品茗股份	900	69,876.00	0.03
137	603939	益丰药房	1,170	65,625.30	0.03
138	688117	圣诺生物	1,672	60,141.84	0.03
139	300037	新宙邦	600	60,060.00	0.03
140	300982	苏文电能	1,000	55,950.00	0.03
141	300260	新莱应材	2,600	55,510.00	0.03
142	002293	罗莱生活	3,800	50,882.00	0.02
143	000887	中鼎股份	4,200	50,736.00	0.02
144	002056	横店东磁	3,900	50,700.00	0.02
145	300777	中简科技	1,100	49,698.00	0.02
146	000547	航天发展	2,600	49,062.00	0.02
147	300735	光弘科技	4,000	48,640.00	0.02
148	002007	华兰生物	1,300	47,684.00	0.02
149	300724	捷佳伟创	400	46,404.00	0.02
150	300476	胜宏科技	2,100	45,885.00	0.02
151	688087	英科再生	2,073	45,523.08	0.02
152	300316	晶盛机电	800	40,400.00	0.02
153	603986	兆易创新	200	37,580.00	0.02
154	600399	抚顺特钢	2,000	36,280.00	0.02
155	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
156	002430	杭氧股份	1,000	34,590.00	0.02

157	603517	绝味食品	400	33,716.00	0.02
158	300659	中孚信息	800	26,856.00	0.01
159	601666	平煤股份	3,200	22,752.00	0.01
160	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
161	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
162	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
163	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
164	603515	欧普照明	100	2,567.00	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601288	农业银行	4,999,560.00	2.38
2	601328	交通银行	4,996,186.00	2.37
3	600900	长江电力	3,194,855.00	1.52
4	600031	三一重工	3,168,235.00	1.51
5	601398	工商银行	2,899,301.00	1.38
6	600887	伊利股份	2,897,286.00	1.38
7	600519	贵州茅台	2,427,522.00	1.15
8	601166	兴业银行	2,299,617.00	1.09
9	601318	中国平安	2,186,541.00	1.04
10	601139	深圳燃气	1,902,174.00	0.90
11	600036	招商银行	1,855,565.00	0.88
12	600309	万华化学	1,832,404.00	0.87
13	601012	隆基股份	1,807,940.00	0.86
14	600690	海尔智家	1,781,338.00	0.85
15	600486	扬农化工	1,735,032.78	0.82
16	600585	海螺水泥	1,698,709.00	0.81
17	600176	中国巨石	1,606,517.00	0.76
18	600438	通威股份	1,550,648.69	0.74
19	601158	重庆水务	1,499,529.00	0.71
20	600018	上港集团	1,499,505.00	0.71

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例
----	------	------	----------	-------------

				(%)
1	601328	交通银行	3,607,946.00	1.71
2	601288	农业银行	2,258,892.00	1.07
3	601398	工商银行	1,859,388.00	0.88
4	601158	重庆水务	1,683,145.00	0.80
5	600585	海螺水泥	1,373,705.00	0.65
6	600900	长江电力	1,258,011.62	0.60
7	601012	隆基股份	1,239,073.00	0.59
8	601318	中国平安	1,192,160.16	0.57
9	600048	保利地产	1,107,635.00	0.53
10	600563	法拉电子	1,077,100.00	0.51
11	600031	三一重工	1,001,211.00	0.48
12	600018	上港集团	899,424.00	0.43
13	600486	扬农化工	896,035.00	0.43
14	601139	深圳燃气	840,192.00	0.40
15	600519	贵州茅台	799,409.00	0.38
16	600438	通威股份	733,050.00	0.35
17	600989	宝丰能源	729,089.00	0.35
18	603369	今世缘	728,436.44	0.35
19	600690	海尔智家	646,719.00	0.31
20	603538	美诺华	555,677.00	0.26

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	104,361,972.56
卖出股票的收入（成交）总额	40,198,668.51

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	10,103,371.20	4.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	775,038.80	0.37

	其中：政策性金融债	775,038.80	0.37
4	企业债券	90,456,000.00	42.97
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	39,013,885.60	18.53
8	同业存单	29,148,000.00	13.85
9	其他	-	-
10	合计	169,496,295.60	80.52

### 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	132008	17 山高 EB	134,110	14,030,588.20	6.67
2	155400	19 杭实 01	100,000	10,090,000.00	4.79
3	136855	16 光控 03	100,000	10,078,000.00	4.79
4	155252	19 中铁 04	100,000	10,077,000.00	4.79
5	155436	19 穗建 01	100,000	10,077,000.00	4.79

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2109	IF2109	-1.00	-1,549,920.00	-64,440.00	-
IH2109	IH2109	-9.00	-9,342,540.00	-218,760.00	-

公允价值变动总额合计	-283,200.00
股指期货投资本期收益	18,174.76
股指期货投资本期公允价值变动	-283,200.00

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，符合既定投资政策及投资目标。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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在追求基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的中长期稳定增值。

### 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

本基金本报告期末投资国债期货。

## 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	1,433,198.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,540,136.13

5	应收申购款	440.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,973,775.12

## 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	132008	17 山高 EB	14,030,588.20	6.67
2	132015	18 中油 EB	6,291,442.50	2.99
3	132004	15 国盛 EB	4,857,204.00	2.31
4	132009	17 中油 EB	3,971,940.00	1.89
5	110033	国贸转债	1,016,048.00	0.48
6	110077	洪城转债	578,399.70	0.27
7	110064	建工转债	503,472.00	0.24
8	113532	海环转债	466,932.00	0.22
9	128083	新北转债	465,255.00	0.22
10	113525	台华转债	462,073.20	0.22
11	110059	浦发转债	403,574.20	0.19
12	110038	济川转债	390,488.40	0.19
13	113014	林洋转债	344,712.00	0.16
14	110068	龙净转债	343,182.40	0.16
15	113505	杭电转债	320,078.20	0.15
16	123004	铁汉转债	255,650.00	0.12
17	113596	城地转债	229,874.40	0.11
18	113519	长久转债	226,436.60	0.11
19	127013	创维转债	210,500.00	0.10
20	113033	利群转债	206,412.00	0.10
21	113530	大丰转债	204,960.00	0.10
22	110052	贵广转债	204,444.20	0.10
23	123010	博世转债	201,460.00	0.10
24	128139	祥鑫转债	200,220.00	0.10
25	127016	鲁泰转债	200,000.00	0.10
26	123049	维尔转债	161,790.00	0.08
27	132022	20 广版 EB	153,413.10	0.07
28	110071	湖盐转债	114,618.40	0.05
29	113599	嘉友转债	111,664.80	0.05

30	113030	东风转债	110,280.00	0.05
31	110034	九州转债	108,240.00	0.05
32	113563	柳药转债	107,230.00	0.05
33	128114	正邦转债	105,680.00	0.05
34	110041	蒙电转债	105,360.00	0.05
35	128044	岭南转债	95,640.00	0.05
36	113036	宁建转债	90,210.40	0.04
37	113039	嘉泽转债	72,141.30	0.03
38	128108	蓝帆转债	60,125.00	0.03
39	110045	海澜转债	55,815.00	0.03
40	128133	奇正转债	54,975.00	0.03
41	127020	中金转债	54,850.00	0.03
42	110073	国投转债	53,855.00	0.03
43	128125	华阳转债	50,900.00	0.02
44	123059	银信转债	42,092.00	0.02

### 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不存在流通受限情况。

## §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
海富通欣睿混合A	246	203,726.17	49,862,845.40	99.49%	253,791.88	0.51%
海富通欣睿混合C	312	505,952.05	157,722,550.70	99.91%	134,490.22	0.09%
合计	558	372,712.68	207,585,396.10	99.81%	388,282.10	0.19%

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	海富通欣睿混合 A	16,874.44	0.0337%
	海富通欣睿混合 C	10.02	0.0000%
	合计	16,884.46	0.0081%

**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	海富通欣睿混合 A	0
	海富通欣睿混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通欣睿混合 A	0~10
	海富通欣睿混合 C	0
	合计	0~10

**§9 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	海富通欣睿混合 A	海富通欣睿混合 C
基金合同生效日（2021 年 2 月 9 日）基金份额总额	40,225,542.01	200,481,289.25
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	19,910,334.44	68,507,150.20
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	10,019,239.17	111,131,398.53
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	50,116,637.28	157,857,040.92

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

**§10 重大事件揭示****10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

**10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请普华永道中天会计师事务所提供审计服务。

#### 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	
东方证券	2	142,812,918.29	100.00%	104,367.04	100.00%	-

注：1、报告期内基金租用券商交易单元未发生变化。

##### 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
东方证券	253,139,365.21	100.00%	818,300,000.00	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海富通欣睿混合型证券投资基金提前结束募集的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-05
2	海富通欣睿混合型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-10
3	海富通欣睿混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-09
4	海富通基金管理有限公司关于网上直销平台开通中国工商银行快捷支付业务并开展申购费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-22
5	海富通基金管理有限公司关于调整网上直销金账户业务并实施费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-22
6	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-24
7	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增珠海盈米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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-30
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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-11

**§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**

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021/2/9-2021/6/30	50,002,250.00	-	-	50,002,250.00	24.04%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险							

主要包括：

- 1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；
- 2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。
- 3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于5000万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。
- 4、其他可能的风险。

另外，当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

注：本基金合同生效日为2021年2月9日，期初份额指基金合同生效日持有份额。

## 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欣睿混合型证券投资基金的文件
- (二) 海富通欣睿混合型证券投资基金基金合同
- (三) 海富通欣睿混合型证券投资基金招募说明书
- (四) 海富通欣睿混合型证券投资基金托管协议
- (五) 中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六) 报告期内海富通欣睿混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36—37 层本基金管理人办公地址。

### 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司

二〇二一年八月三十一日