

# 海富通消费核心资产混合型证券投资基金

## 2021 年中期报告

### 2021 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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.....	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的真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	15
6.1 资产负债表.....	15
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> .....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	47
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.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
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 .....	53
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>53</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变 .....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
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 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8 其他重大事件 .....	56
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>57</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>58</b>
12.1 备查文件目录 .....	58
12.2 存放地点 .....	58
12.3 查阅方式 .....	59

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通消费核心资产混合型证券投资基金	
基金简称	海富通消费核心混合	
基金主代码	010220	
交易代码	010220	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2020 年 11 月 4 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	810,531,185.38 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通消费核心混合 A	海富通消费核心混合 C
下属分级基金的交易代码	010220	010221
报告期末下属分级基金的份额总额	691,974,922.73 份	118,556,262.65 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选消费主题的核心资产型股票投资，在严格控制投资风险的前提下，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金通过对国内外宏观经济及证券市场整体走势进行前瞻性研究，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，动态把握不同资产类别的投资价值、投资时机以及其风险收益特征的相对变化，进行基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间的合理配置。在严格控制投资风险的基础上，实现本基金长期、持续、稳定增值。</p> <p>股票投资策略方面，本基金所界定的消费核心资产型股票主要是指消费制造和消费服务业及与其密切相关上下游产业内，在具有领先地位、良好业绩及稳定增长率的上市公司中，已具备一定领先优势的上市公司；或与消费主题相关，正处于培育期、发展期或未来有潜力成长为所属细分领域龙头的上市公司。行业配置方面，根据本基金投资理念及投资目标，根据消费领域各子行业的特征，从产业发展生命周期、行业增长前景、行业景气度、行业竞争格局、技术水平及其发展趋势等多角度，综合评估各行业的投资价值。个股甄选方面，本基金的股票投资将采用自下而上的基本面研究，再通过定量与定性相结合的分析方法，对备选行业内部企业的基本面、估值水平进行综合研判，精选优质个股进行投资。</p> <p>另外，本基金的投资策略还包括债券投资组合策略、资产支持证券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略。</p>
业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%

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。
--------	---

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	许俊
	联系电话	021-38650788	010-66594319
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦 36-37层	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦 36-37层	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		杨仓兵	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	海富通基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号 东亚银行金融大厦 36-37 层

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021年1月1日至2021年6月30日）	
	海富通消费核心混合 A	海富通消费核心混合 C

本期已实现收益	7,544,164.22	2,030,264.29
本期利润	-45,536,529.02	-10,234,795.03
加权平均基金份额本期利润	-0.0552	-0.0592
本期加权平均净值利润率	-5.60%	-5.99%
本期基金份额净值增长率	-6.09%	-6.48%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2021年6月30日)</b>	
	海富通消费核心混合 A	海富通消费核心混合 C
期末可供分配利润	-23,185,546.41	-4,570,920.01
期末可供分配基金份额利润	-0.0335	-0.0386
期末基金资产净值	668,789,376.32	113,985,342.64
期末基金份额净值	0.9665	0.9614
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2021年6月30日)</b>	
	海富通消费核心混合 A	海富通消费核心混合 C
基金份额累计净值增长率	-3.35%	-3.86%

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

#### 海富通消费核心混合 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	0.03%	0.62%	-3.86%	0.76%	3.89%	-0.14%
过去三个月	1.38%	0.86%	1.76%	1.06%	-0.38%	-0.20%
过去六个月	-6.09%	1.05%	-2.66%	1.48%	-3.43%	-0.43%
自基金合同生效起至今	-3.35%	0.93%	8.91%	1.35%	-12.26%	-0.42%

#### 海富通消费核心混合 C

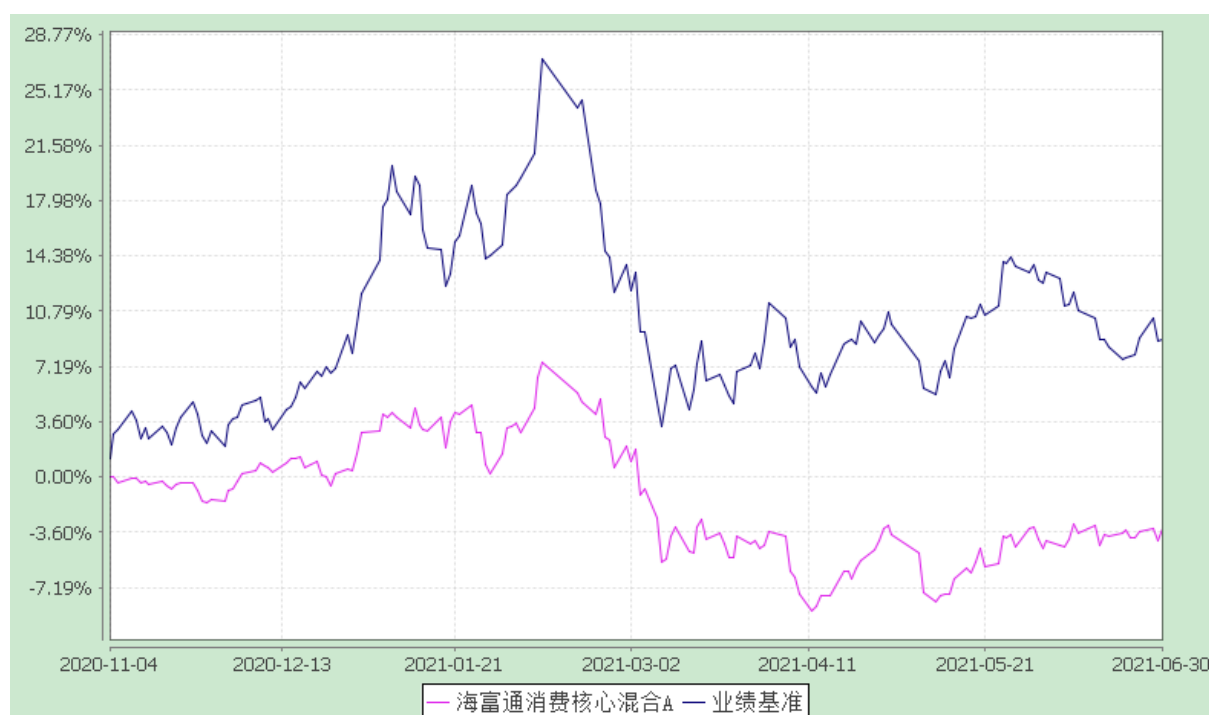
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.03%	0.62%	-3.86%	0.76%	3.83%	-0.14%
过去三个月	1.18%	0.87%	1.76%	1.06%	-0.58%	-0.19%

过去六个月	-6.48%	1.05%	-2.66%	1.48%	-3.82%	-0.43%
自基金合同生效起至今	-3.86%	0.93%	8.91%	1.35%	-12.77%	-0.42%

### 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

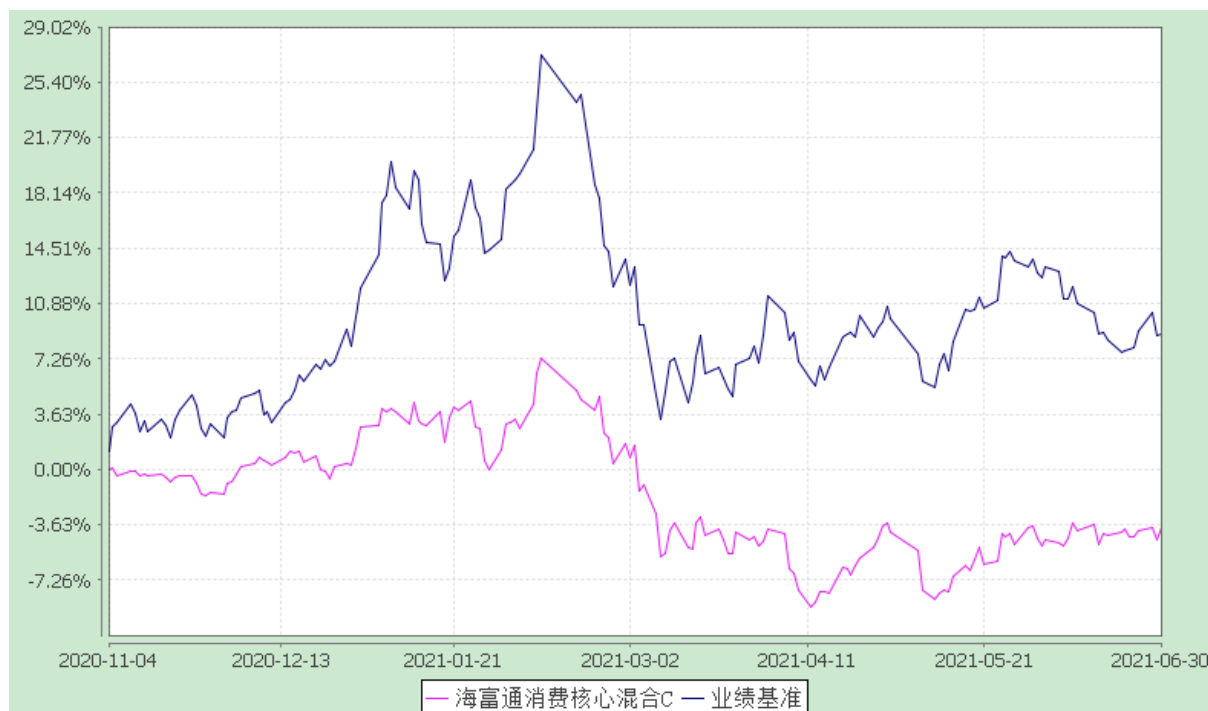
海富通消费核心资产混合型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2020 年 11 月 4 日至 2021 年 6 月 30 日)

#### 海富通消费核心混合 A



#### 海富通消费核心混合 C





注：1、本基金合同于 2020 年 11 月 4 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。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		
黄峰	本基金的基金经理；公募权益投资部副总监。	2020-11-04	-	11 年	硕士。持有基金从业人员资格证书。历任大公国际资信评估公司信用分析部分析师，深圳九富投资顾问有限公司项目部员工，大连獐子岛渔业集团股份有限公司证券部负责人、证券事务代表，华创证券有限责任公司研究所高级研究员，2011 年 5 月加入海富通基金管理有限公司，历任股票分析师、基金经理助理。现任公募权益投资部副总监。2014 年 12 月至 2017 年 6 月任海富通股票混合、海富通中小盘混合和海富通领先成长混合的基金经理。2014 年 12 月起担任海富通内需热点混合的基金经理。2019 年 6 月起兼任海富通精选贰号混合和海富通精选混合的基金经理。2020 年 11 月起兼任海富通消费核心混合基金经理。2020 年 12 月起兼任海富通成长价值混合基金经理。2021 年 4 月起兼任海富通消费优选混合基金经理。

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

2、证券从业年限的计算标准为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

从上半年市场内部的结构看，周期和成长交相呼应成为市场两条主线。周期主线在一季度演绎得淋漓尽致，尤其在碳达峰的政策预期下，与此匹配的是相关行业上半年的业绩表现。同样是业绩靓丽的电动车产业链和半导体，五月以来行情同样演绎得如火如荼。消费领域除了医药 CXO 和次高

端白酒，整体表现较弱。市场上半年赚钱效应明显，小盘股表现优于大盘股，核心资产相对疲弱。市场交易集中度有所下降，双创指数表现靓丽。整个市场反映出经济结构转型带来的红利，中国优势供应链成为市场配置热点。

上半年，本基金先谨慎后乐观，一季度仓位缓慢提升至中性偏低水平，二季度加仓至偏高水平。结构上，降低了组合高估值个股的配置比例，清仓高位周期个股、基本面连续低预期个股，降低基本面遭遇短期困难个股配置比例，主要分布在建材、电子、医药行业；另一方面，不断增加中小市值的细分行业龙头个股配置数量与比例，主要是与消费关联紧密的制造业领域，以及家电新品类个股。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期，本基金 A 类份额净值增长率为-6.09%，同期业绩比较基准收益率为-2.66%，基金净值跑输业绩比较基准 3.43 个百分点；本基金 C 类份额净值增长率为-6.48%，同期业绩比较基准收益率为-2.66%，基金净值跑输业绩比较基准 3.82 个百分点。主要原因系医药及半导体持仓个股因一季报低预期，对组合业绩负贡献较大。

#### 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，或更加容易把握。行业格局较为良好的周期板块或可享受业绩增长带来的收益。

下半年，本基金将在恪守能力圈、守住中长期视角下的核心资产的前提下，重点做好两类工作：一方面做好核心资产的风险防范工作，另一方面加大对高成长性资产的研究与投资力度。

#### 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

一、本基金本报告期内无应分配的收益。

二、已实施的利润分配：无。

三、不存在应分配但尚未实施的利润。

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

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

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

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金

融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：海富通消费核心资产混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	139,242,298.88	718,375,898.11
结算备付金		744,474.80	3,324,643.23
存出保证金		178,103.73	155,696.38
交易性金融资产	6.4.7.2	646,711,130.73	700,183,094.62
其中：股票投资		646,711,130.73	700,183,094.62
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		1,557,142.81	-
应收利息	6.4.7.5	13,269.76	75,046.13
应收股利		-	-
应收申购款		77,498.95	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		788,523,919.66	1,422,114,378.47
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	9,216,147.53
应付赎回款		4,062,665.46	-
应付管理人报酬		990,162.24	1,746,884.19

应付托管费		165,027.05	291,147.36
应付销售服务费		77,526.89	196,940.14
应付交易费用	6.4.7.7	359,512.32	515,332.36
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	94,306.74	20,000.00
负债合计		5,749,200.70	11,986,451.58
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	810,531,185.38	1,370,415,874.20
未分配利润	6.4.7.10	-27,756,466.42	39,712,052.69
所有者权益合计		782,774,718.96	1,410,127,926.89
负债和所有者权益总计		788,523,919.66	1,422,114,378.47

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 810,531,185.38 份。其中海富通消费核心混合 A 类基金份额总额 691,974,922.73 份，基金份额净值 0.9665 元；海富通消费核心混合 C 类基金份额总额 118,556,262.65 份，基金份额净值 0.9614 元。

## 6.2 利润表

会计主体：海富通消费核心资产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
<b>一、收入</b>		<b>-44,851,520.88</b>
1.利息收入		588,416.43
其中：存款利息收入	6.4.7.11	588,416.43
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）		18,984,002.43
其中：股票投资收益	6.4.7.12	14,005,703.92
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	4,978,298.51



3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-65,345,752.56
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	921,812.82
<b>减：二、费用</b>		<b>10,919,803.17</b>
1. 管理人报酬		7,363,756.62
2. 托管费		1,227,292.78
3. 销售服务费		681,128.73
4. 交易费用	6.4.7.19	1,542,298.18
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	105,326.86
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-55,771,324.05</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-55,771,324.05</b>

注：基金合同成立于 2020 年 11 月 04 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：海富通消费核心资产混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,370,415,874.20	39,712,052.69	1,410,127,926.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-55,771,324.05	-55,771,324.05
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）	-559,884,688.82	-11,697,195.06	-571,581,883.88
其中：1.基金申购款	22,389,255.49	-302,696.81	22,086,558.68
2.基金赎回款	-582,273,944.31	-11,394,498.25	-593,668,442.56
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）	810,531,185.38	-27,756,466.42	782,774,718.96

注：基金合同成立于 2020 年 11 月 04 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

海富通消费核心资产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]第 2025 号《关于准予海富通消费核心资产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《海富通消费核心资产混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,369,963,919.08 元，已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 普华永道中天验字(2020)第 0954 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通消费核心资产混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 11 月 04 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,370,415,874.20 份，其中认购资金利息折合 451,955.12 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《海富通消费核心资产混合型证券投资基金基金合同》和《海富通消费核心资产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《海富通消费核心资产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）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可交换债券、可转换债券）、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。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 60%-95%，其中投资于本基金所界定的消费核心资产主题

证券的比例不低于非现金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的保证金以后，本基金保留的现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为：中证内地消费主题指数收益率×80%+中证全债指数收益率×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》、《海富通消费核心资产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 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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。

##### 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中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中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或票面利率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

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	139,242,298.88
定期存款	-
其他存款	-
合计	139,242,298.88

#### 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	672,617,926.03	646,711,130.73	-25,906,795.30
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	672,617,926.03	646,711,130.73	-25,906,795.30

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	12,896.05
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	301.50
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	0.03
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	72.18
合计	13,269.76

#### 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	359,512.32
银行间市场应付交易费用	-
合计	359,512.32

#### 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	87.19
应付证券出借违约金	-
预提费用	94,219.55
合计	94,306.74

#### 6.4.7.9 实收基金

海富通消费核心混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额	账面金额

上年度末	1,080,527,481.44	1,080,527,481.44
本期申购	10,739,107.86	10,739,107.86
本期赎回（以“-”号填列）	-399,291,666.57	-399,291,666.57
本期末	691,974,922.73	691,974,922.73

海富通消费核心混合 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	289,888,392.76	289,888,392.76
本期申购	11,650,147.63	11,650,147.63
本期赎回（以“-”号填列）	-182,982,277.74	-182,982,277.74
本期末	118,556,262.65	118,556,262.65

注：1、本基金自 2020 年 10 月 09 日起至 2020 年 10 月 30 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 1,369,963,919.08 元，折合为 1,369,963,919.08 份基金份额(其中 A 类基金份额 1,080,187,680.44 份，C 类基金份额 289,776,238.64 份)。根据《海富通消费核心资产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 451,955.12 元在本基金成立后，折算为 451,955.12 份基金份额(其中 A 类基金份额 339,801.00 份，C 类基金份额 112,154.12 份)，划入基金份额持有人账户。

2、根据《海富通消费核心资产混合型证券投资基金招募说明书》、《海富通消费核心资产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 2020 年 11 月 4 日(基金合同生效日) 2021 年 2 月 2 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 2 月 3 日起开始办理。

#### 6.4.7.10 未分配利润

海富通消费核心混合 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	499,719.09	31,104,694.58	31,604,413.67
本期利润	7,544,164.22	-53,080,693.24	-45,536,529.02
本期基金份额交易产生的变动数	-5,218,891.58	-4,034,539.48	-9,253,431.06

其中：基金申购款	159,501.97	-254,589.57	-95,087.60
基金赎回款	-5,378,393.55	-3,779,949.91	-9,158,343.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,824,991.73	-26,010,538.14	-23,185,546.41

海富通消费核心混合 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	-226,623.66	8,334,262.68	8,107,639.02
本期利润	2,030,264.29	-12,265,059.32	-10,234,795.03
本期基金份额交易产生的变动数	-1,927,413.03	-516,350.97	-2,443,764.00
其中：基金申购款	127,798.49	-335,407.70	-207,609.21
基金赎回款	-2,055,211.52	-180,943.27	-2,236,154.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-123,772.40	-4,447,147.61	-4,570,920.01

**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	575,635.92
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	10,316.77
其他	2,463.74
合计	588,416.43

**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	632,346,722.09
减：卖出股票成本总额	618,341,018.17
买卖股票差价收入	14,005,703.92

**6.4.7.13 债券投资收益**

本基金本报告期无债券投资收益。

**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	4,978,298.51
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	4,978,298.51

**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	-65,345,752.56
——股票投资	-65,345,752.56
——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	-65,345,752.56

**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	920,995.87
基金转换费收入	816.95
合计	921,812.82

**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	1,542,298.18
银行间市场交易费用	-
合计	1,542,298.18

#### 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	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	10,707.31
开户费	400.00
合计	105,326.86

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表报出日，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
中国银行股份有限公司 (“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
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
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

本基金本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过股票交易，基金合同成立于 2020 年 11 月 04 日，上年度可比期间无比较数据。

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易，基金合同成立于 2020 年 11 月 04 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

本基金本报告期内没有应支付关联方的佣金，基金合同成立于 2020 年 11 月 04 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1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,363,756.62
其中：支付销售机构的客户维护费	2,850,538.24

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 1.50% 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 X 1.50% / 当年天数。

2、基金合同成立于 2020 年 11 月 04 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1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,227,292.78

注：1、支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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 X 0.25% / 当年天数。

2、基金合同成立于 2020 年 11 月 04 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		
	海富通消费核心混合 A	海富通消费核心混合 C	合计
中国银行	-	16,120.49	16,120.49
海通证券	-	147,840.13	147,840.13
海富通	-	28,971.88	28,971.88
合计	-	192,932.50	192,932.50

注：1、支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日基金销售服务费 = 前一日 C 类基金份额对应的资产净值 × 0.80% ÷ 当年天数。

2、基金合同成立于 2020 年 11 月 04 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 2020 年 11 月 04 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**

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务，基金合同成立于 2020 年 11 月 04 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**

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务，基金合同成立于 2020 年 11 月 04 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1月1日至2021年6月30日



	海富通消费核心混合A	海富通消费核心混合C
期初持有的基金份额	10,002,250.23	-
期间申购/买入总份额	-	-
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	10,002,250.23	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.45%	-

注: 1、本基金募集期间, 本基金管理人运用自有资金总计 10,001,000.00 元认购了本基金, 其中, 认购费用为 1,000.00 元, 认购期利息 2,250.23 元, 符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

2、基金合同成立于 2020 年 11 月 04 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金, 基金合同成立于 2020 年 11 月 04 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1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	139,242,298.88	575,635.92

注: 基金合同成立于 2020 年 11 月 04 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1月1日至2021年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
海通证券	300933	中辰股份	网下发行	11,117	37,464.29
海通证券	688680	海优新材	网下发行	2,795	195,482.30

海通证券	300940	南极光	网下发行	3,068	39,147.68
海通证券	688687	凯因科技	网下发行	5,354	101,618.92
海通证券	688665	四方光电	网下发行	1,687	49,817.11
海通证券	688092	爱科科技	网下发行	1,137	21,728.07
海通证券	688626	翔宇医疗	网下发行	3,652	105,250.64
海通证券	688630	芯碁微装	网下发行	3,397	51,736.31
海通证券	688682	霍莱沃	网下发行	946	43,251.12
海通证券	300981	中红医疗	网下发行	6,003	291,685.77
海通证券	688217	睿昂基因	网下发行	1,040	19,156.80

注：基金合同成立于 2020 年 11 月 04 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

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项，基金合同成立于 2020 年 11 月 04 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
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股锁定流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股锁定流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股锁定流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股锁定流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-

				受限						
30093 1	通用 电梯	2021-0 1-13	2021-0 7-21	新股 锁定 流通 受限	4.31	13.11	672	2,896. 32	8,809. 92	-
30093 3	中辰 股份	2021-0 1-15	2021-0 7-22	新股 锁定 流通 受限	3.37	10.44	1,112	3,747. 44	11,609 .28	-
30093 7	药易 购	2021-0 1-20	2021-0 7-27	新股 锁定 流通 受限	12.25	53.71	244	2,989. 00	13,105 .24	-
30094 0	南极 光	2021-0 1-27	2021-0 8-03	新股 锁定 流通 受限	12.76	43.38	307	3,917. 32	13,317 .66	-
30094 1	创识 科技	2021-0 2-02	2021-0 8-09	新股 锁定 流通 受限	21.31	49.94	399	8,502. 69	19,926 .06	-
30094 2	易瑞 生物	2021-0 2-02	2021-0 8-09	新股 锁定 流通 受限	5.31	28.52	443	2,352. 33	12,634 .36	-
30094 3	春晖 智控	2021-0 2-03	2021-0 8-10	新股 锁定 流通 受限	9.79	23.01	255	2,496. 45	5,867. 55	-
30094 5	曼卡 龙	2021-0 2-03	2021-0 8-10	新股 锁定 流通 受限	4.56	18.88	474	2,161. 44	8,949. 12	-
30094 8	冠中 生态	2021-0 2-18	2021-0 8-25	新股 锁定 流通 受限	13.00	27.42	324	2,808. 00	8,884. 08	4
30095 0	德固 特	2021-0 2-24	2021-0 9-03	新股 锁定 流通 受限	8.41	39.13	219	1,841. 79	8,569. 47	-
30095 2	恒辉 安防	2021-0 3-03	2021-0 9-13	新股 锁定 流通 受限	11.72	27.08	340	3,984. 80	9,207. 20	-

300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股 锁定 流通 受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股 锁定 流通 受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股 锁定 流通 受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股 锁定 流通 受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股 锁定 流通 受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股 锁定 流通 受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新股 锁定 流通 受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股 锁定 流通 受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股 锁定 流通 受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	高络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股 锁定 流通 受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股 锁定 流通 受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
30098	中红	2021-0	2021-1	新股	48.59	90.39	601	29,202	54,324	-

1	医疗	4-19	0-27	锁定 流通 受限				.59	.39	
30098 5	致远 新能	2021-0 4-21	2021-1 0-29	新股 锁定 流通 受限	24.90	24.81	295	7,345. 50	7,318. 95	-
30098 6	志特 新材	2021-0 4-21	2021-1 1-01	新股 锁定 流通 受限	14.79	30.57	264	3,904. 56	8,070. 48	-
30098 7	川网 传媒	2021-0 4-28	2021-1 1-11	新股 锁定 流通 受限	6.79	26.81	301	2,043. 79	8,069. 81	-
30099 1	创益 通	2021-0 5-12	2021-1 1-22	新股 锁定 流通 受限	13.06	26.51	254	3,317. 24	6,733. 54	-
30099 3	玉马 遮阳	2021-0 5-17	2021-1 1-24	新股 锁定 流通 受限	12.10	19.29	410	4,961. 00	7,908. 90	-
30099 5	奇德 新材	2021-0 5-17	2021-1 1-26	新股 锁定 流通 受限	14.72	23.32	191	2,811. 52	4,454. 12	-
30099 6	普联 软件	2021-0 5-26	2021-1 2-03	新股 锁定 流通 受限	20.81	42.23	241	5,015. 21	10,177 .43	-
30099 7	欢乐 家	2021-0 5-26	2021-1 2-02	新股 锁定 流通 受限	4.94	13.05	928	4,584. 32	12,110 .40	-
30099 8	宁波 方正	2021-0 5-25	2021-1 2-02	新股 锁定 流通 受限	6.02	21.32	201	1,210. 02	4,285. 32	-
30100 9	可靠 股份	2021-0 6-08	2021-1 2-17	新股 锁定 流通 受限	12.54	27.89	801	10,044 .54	22,339 .89	-
30101 0	晶雪 节能	2021-0 6-09	2021-1 2-20	新股 锁定	7.83	17.61	218	1,706. 94	3,838. 98	-

				流通受限						
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股锁定流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股锁定流通受限	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	-
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	-
688113	联测科技	2021-04-26	2021-11-08	新股锁定流通受限	19.14	49.29	1,415	27,083.10	69,745.35	-
688191	智洋创新	2021-03-30	2021-10-08	新股锁定流通受限	11.38	17.74	3,203	36,450.14	56,821.22	-
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	-
688260	昀冢科技	2021-03-25	2021-10-08	新股锁定流通受限	9.63	16.41	2,990	28,793.70	49,065.90	-

688345	博力威	2021-06-03	2021-12-13	新股锁定流通受限	25.91	55.53	2,332	60,422.12	129,495.96	-
688636	智明达	2021-03-30	2021-10-08	新股锁定流通受限	34.50	80.72	918	31,671.00	74,100.96	-
688682	霍莱沃	2021-04-13	2021-10-20	新股锁定流通受限	45.72	103.85	946	43,251.12	98,242.10	-

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、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3、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。

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

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，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 06 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持



证券 (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 0.16%。

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	139,242,298.88	-	-	-	139,242,298.8

					8
结算备付金	744,474.80	-	-	-	744,474.80
存出保证金	178,103.73	-	-	-	178,103.73
交易性金融资产	-	-	-	646,711,130.73	646,711,130.73
应收证券清算款	-	-	-	1,557,142.81	1,557,142.81
应收利息	-	-	-	13,269.76	13,269.76
应收申购款	-	-	-	77,498.95	77,498.95
资产总计	140,164,877.41	-	-	648,359,042.25	788,523,919.66
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,062,665.46	4,062,665.46
应付管理人报酬	-	-	-	990,162.24	990,162.24
应付托管费	-	-	-	165,027.05	165,027.05
应付销售服务费	-	-	-	77,526.89	77,526.89
应付交易费用	-	-	-	359,512.32	359,512.32
其他负债	-	-	-	94,306.74	94,306.74
负债总计	-	-	-	5,749,200.70	5,749,200.70
利率敏感度缺口	140,164,877.41	-	-	642,609,841.55	782,774,718.96
<b>上年度末</b>					
<b>2020 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	718,375,898.11	-	-	-	718,375,898.11
结算备付金	3,324,643.23	-	-	-	3,324,643.23
存出保证金	155,696.38	-	-	-	155,696.38
交易性金融资产	-	-	-	700,183,094.62	700,183,094.62
应收利息	-	-	-	75,046.13	75,046.13
资产总计	721,856,237.72	-	-	700,258,140.75	1,422,114,378.47
负债					
应付证券清算款	-	-	-	9,216,147.53	9,216,147.53
应付管理人报酬	-	-	-	1,746,884.19	1,746,884.19

应付托管费	-	-	-	291,147.36	291,147.36
应付销售服务费	-	-	-	196,940.14	196,940.14
应付交易费用	-	-	-	515,332.36	515,332.36
其他负债	-	-	-	20,000.00	20,000.00
负债总计	-	-	-	11,986,451.58	11,986,451.58
利率敏感度缺口	721,856,237.72	-	-	688,271,689.17	1,410,127,926.89

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。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	646,711,130.7 3	82.62	700,183,094.6 2	49.65
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	646,711,130.7 3	82.62	700,183,094.6 2	49.65

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	29,466,348.28	36,806,689.04
业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-29,466,348.28	-36,806,689.04	

#### 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	646,711,130.73	82.02

	其中：股票	646,711,130.73	82.02
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	139,986,773.68	17.75
8	其他各项资产	1,826,015.25	0.23
9	合计	788,523,919.66	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	5,850.78	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	570,275,449.88	72.85
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	46,404.58	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	76,313,226.27	9.75
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	22,457.73	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	646,711,130.73	82.62

### 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	600570	恒生电子	816,169	76,107,759.25	9.72
2	600521	华海药业	3,601,624	75,201,909.12	9.61
3	600887	伊利股份	2,017,000	74,286,110.00	9.49
4	600519	贵州茅台	35,200	72,395,840.00	9.25
5	688169	石头科技	42,877	54,067,897.00	6.91
6	002139	拓邦股份	2,803,600	50,436,764.00	6.44
7	002332	仙琚制药	3,430,000	43,012,200.00	5.49
8	002402	和而泰	1,617,200	38,764,284.00	4.95
9	300638	广和通	825,409	38,546,600.30	4.92
10	603277	银都股份	1,219,750	28,359,187.50	3.62
11	002111	威海广泰	1,489,600	27,006,448.00	3.45
12	002833	弘亚数控	588,480	22,803,600.00	2.91
13	300702	天宇股份	637,158	22,568,136.36	2.88
14	603129	春风动力	169,554	21,038,260.32	2.69
15	688658	悦康药业	16,580	372,884.20	0.05
16	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.02
17	603486	科沃斯	600	136,848.00	0.02
18	688345	博力威	2,332	129,495.96	0.02
19	300986	志特新材	2,632	103,429.84	0.01
20	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
21	688682	霍莱沃	946	98,242.10	0.01
22	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
23	688636	智明达	918	74,100.96	0.01
24	688113	联测科技	1,415	69,745.35	0.01

25	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
26	688191	智洋创新	3,203	56,821.22	0.01
27	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.01
28	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
29	688260	昀冢科技	2,990	49,065.90	0.01
30	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
31	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
32	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
33	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
34	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
35	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
36	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
37	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
38	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
39	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
40	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
41	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
42	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
43	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
44	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
45	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
46	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
47	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
48	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
49	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
50	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
51	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
52	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
53	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
54	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
55	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
56	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
57	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
58	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
59	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
60	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
61	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
62	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
63	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
64	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
65	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
66	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
67	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
68	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00



69	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
70	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
71	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
72	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
73	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	688169	石头科技	56,327,837.45	3.99
2	600521	华海药业	44,403,496.44	3.15
3	002139	拓邦股份	38,368,997.25	2.72
4	600519	贵州茅台	38,207,629.00	2.71
5	300601	康泰生物	37,835,425.32	2.68
6	002402	和而泰	35,096,426.61	2.49
7	300638	广和通	33,789,731.09	2.40
8	300702	天宇股份	33,399,096.50	2.37
9	002111	威海广泰	29,303,570.00	2.08
10	600176	中国巨石	27,889,375.81	1.98
11	002833	弘亚数控	25,975,806.80	1.84
12	603129	春风动力	25,169,513.37	1.78
13	600570	恒生电子	25,049,576.49	1.78
14	603277	银都股份	23,877,205.10	1.69
15	002332	仙琚制药	22,837,305.36	1.62
16	688008	澜起科技	21,572,515.40	1.53
17	002422	科伦药业	21,206,792.51	1.50
18	600887	伊利股份	19,816,775.80	1.41
19	300271	华宇软件	19,644,354.91	1.39
20	000869	张裕 A	17,626,399.65	1.25

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	600176	中国巨石	129,595,348.30	9.19
2	600519	贵州茅台	68,572,798.56	4.86

3	300601	康泰生物	59,004,175.32	4.18
4	300782	卓胜微	40,633,354.46	2.88
5	300702	天宇股份	36,083,159.88	2.56
6	603129	春风动力	34,543,539.84	2.45
7	688008	澜起科技	33,654,042.06	2.39
8	000739	普洛药业	30,865,179.66	2.19
9	002422	科伦药业	30,024,256.15	2.13
10	600521	华海药业	27,711,717.65	1.97
11	600570	恒生电子	24,967,903.87	1.77
12	600887	伊利股份	22,686,961.04	1.61
13	300271	华宇软件	18,971,168.03	1.35
14	000869	张裕 A	18,072,234.38	1.28
15	688981	中芯国际	13,327,176.14	0.95
16	002332	仙琚制药	8,002,510.00	0.57
17	603277	银都股份	7,382,767.00	0.52
18	002833	弘亚数控	5,645,284.60	0.40
19	688819	天能股份	1,343,218.05	0.10
20	688425	铁建重工	960,965.70	0.07

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	630,214,806.84
卖出股票的收入（成交）总额	632,346,722.09

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。

### 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

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。国债期货相关投资严格遵循法律法规及中国证监会的规定。

### 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

本报告期内本基金未投资国债期货。

## 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	178,103.73
2	应收证券清算款	1,557,142.81
3	应收股利	-
4	应收利息	13,269.76
5	应收申购款	77,498.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,826,015.25

**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**

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

**§8 基金份额持有人信息****8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
海富通消费核心混合 A	9,570	72,306.68	10,348,358.78	1.50%	681,626,563.95	98.50%
海富通消费核心混合 C	15,141	7,830.15	149,686.94	0.13%	118,406,575.71	99.87%

合计	24,711	32,800.42	10,498,045.72	1.30%	800,033,139.66	98.70%
----	--------	-----------	---------------	-------	----------------	--------

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	海富通消费核心混合 A	2,453,169.45	0.3545%
	海富通消费核心混合 C	1,693,587.02	1.4285%
	合计	4,146,756.47	0.5116%

## 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	海富通消费核心混合 A	>100
	海富通消费核心混合 C	50~100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通消费核心混合 A	0
	海富通消费核心混合 C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通消费核心混合 A	海富通消费核心混合 C
基金合同生效日（2020 年 11 月 4 日）基金份额总额	1,080,527,481.44	289,888,392.76
本报告期期初基金份额总额	1,080,527,481.44	289,888,392.76
本报告期基金总申购份额	10,739,107.86	11,650,147.63
减：本报告期基金总赎回份额	399,291,666.57	182,982,277.74
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	691,974,922.73	118,556,262.65

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	
华创证券	1	445,125,588.60	35.49%	183,081.52	23.72%	-
华西证券	1	261,129,154.16	20.82%	190,963.71	24.75%	-
国盛证券	2	167,320,495.31	13.34%	122,362.45	15.86%	-
国泰君安	2	146,151,082.11	11.65%	106,425.83	13.79%	-
招商证券	2	107,819,272.14	8.60%	78,850.04	10.22%	-
西南证券	2	80,538,271.40	6.42%	57,287.21	7.42%	-
天风证券	2	29,060,954.32	2.32%	20,670.95	2.68%	-
野村东方国际证券	1	16,970,614.85	1.35%	12,071.37	1.56%	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

## 2、(1)交易单元的选择标准

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

## (2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

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

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
华创证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际 证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

## 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
2	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
3	海富通消费核心资产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	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	2021-01-26
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	2021-01-29
5	海富通基金管理有限公司关于海富通消费核心资产混合型证券投资基金 A 类份额实行网上直销费率优惠的公告	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	2021-02-01
6	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-02
7	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-04
8	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
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	2021-03-16
10	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
11	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
12	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



13	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	2021-03-24
14	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-25
15	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-29
16	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行招赢通为销售平台的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30
17	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京度小满基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-08
18	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增民商基金销售(上海)有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-13
19	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-15
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	2021-04-21
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	2021-05-11
22	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加中信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	2021-05-20

## §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消费核心资产混合型证券投资基金的文件
- （二）海富通消费核心资产混合型证券投资基金基金合同
- （三）海富通消费核心资产混合型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通消费核心资产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）报告期内海富通消费核心资产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