

# 海富通欣益灵活配置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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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.....	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.....	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.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告</b> .....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55

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> .....	<b>56</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
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 .....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
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 .....	58
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>60</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>62</b>
12.1 备查文件目录 .....	62
12.2 存放地点 .....	62
12.3 查阅方式 .....	62

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	海富通欣益混合	
基金主代码	519221	
交易代码	519221	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2016年9月7日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	712,283,119.77 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通欣益混合 A	海富通欣益混合 C
下属分级基金的交易代码	519222	519221
报告期末下属分级基金的份额总额	435,787,142.32 份	276,495,977.45 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金坚持灵活的资产配置，在严格控制下跌风险的基础上，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	本基金的资产配置策略以基金的投资目标为中心，首先按照投资时钟理论，根据宏观预期环境判断经济周期所处的阶段，作出权益类资产的初步配置，并根据投资时钟判断大致的行业配置；其次结合证券市场趋势指标，判断证券市场指数的大致风险收益比，从而做出权益类资产的具体仓位选择。债券投资采取“自上而下”的策略，深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以价值发现为基础，在市场创新和变化中寻找投资机会，采取利率预期、久期管理、收益率曲线策略、收益率利差策略和套利等积极投资管理方式，确定和构造合理的债券组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露	姓名	岳冲	陆志俊
	联系电话	021-38650788	95559

负责人	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		40088-40099	95559
传真		021-33830166	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188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	中国（上海）长宁区仙霞路18号	
邮政编码		200120	200336
法定代表人		杨仓兵	任德奇

## 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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## §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）	
	海富通欣益混合 A	海富通欣益混合 C
本期已实现收益	14,637,812.52	10,433,160.38
本期利润	14,390,875.06	9,789,171.16
加权平均基金份额本期利润	0.0389	0.0442
本期加权平均净值利润率	2.96%	2.72%
本期基金份额净值增长率	3.72%	3.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
	海富通欣益混合 A	海富通欣益混合 C
期末可供分配利润	116,960,541.05	156,646,277.49
期末可供分配基金份额利润	0.2684	0.5665

期末基金资产净值	583,568,002.55	456,663,002.86
期末基金份额净值	1.339	1.652
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2021年6月30日)</b>	
	海富通欣益混合 A	海富通欣益混合 C
基金份额累计净值增长率	56.33%	78.95%

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

海富通欣益混合 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	0.30%	0.22%	-0.48%	0.24%	0.78%	-0.02%
过去三个月	3.00%	0.27%	1.98%	0.29%	1.02%	-0.02%
过去六个月	3.72%	0.40%	1.75%	0.40%	1.97%	0.00%
过去一年	16.23%	0.37%	9.50%	0.41%	6.73%	-0.04%
过去三年	40.63%	0.29%	25.88%	0.40%	14.75%	-0.11%
自基金合同生效起至今	56.33%	0.26%	30.59%	0.35%	25.74%	-0.09%

海富通欣益混合 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	0.30%	0.20%	-0.48%	0.24%	0.78%	-0.04%
过去三个月	2.93%	0.27%	1.98%	0.29%	0.95%	-0.02%
过去六个月	3.64%	0.40%	1.75%	0.40%	1.89%	0.00%
过去一年	16.01%	0.37%	9.50%	0.41%	6.51%	-0.04%
过去三年	67.31%	0.77%	25.88%	0.40%	41.43%	0.37%
自基金合同生效起至今	78.95%	0.62%	30.59%	0.35%	48.36%	0.27%

#### 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

海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金

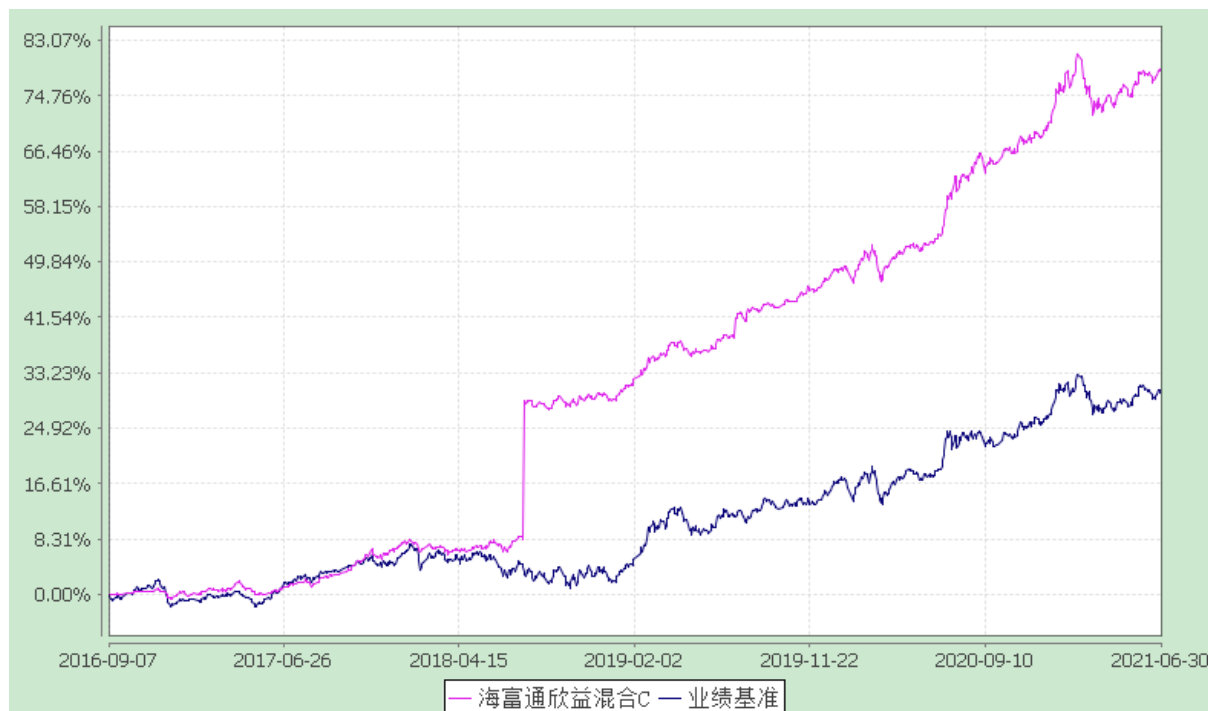
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016 年 9 月 7 日至 2021 年 6 月 30 日)

海富通欣益混合 A



海富通欣益混合 C



注：本基金合同于 2016 年 9 月 7 日生效，按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）



投资限制中规定的各项比例。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 87 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通可转债优选债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通富祥混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多

因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通添鑫收益债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通惠睿精选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
夏妍妍	本基金的基金经理	2018-01-05	-	6 年	上海交通大学经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任西门子金融服务集团西门子管理培训生，西门子财务租赁有限公司上海分公司高级财务分析师，2014 年加入海富通基金管理有限公司，历任固定收益投资部固定收益分析师、基金经理助理。2018 年 1 月起任海富通欣益混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通一年定期开放债券基金经理。2018 年 4 月至

					2021 年 5 月任海富通融丰定开债券基金经理。2019 年 5 月起兼任海富通安颐收益混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通聚合纯债、海富通富祥混合及海富通瑞合纯债的基金经理。2019 年 10 月至 2020 年 11 月任海富通瑞丰债券基金经理。2020 年 5 月起兼任海富通富盈混合基金经理。2021 年 5 月起兼任海富通美元债（QDII）基金经理。
朱斌全	本基金的基金经理	2019-10-15	-	14 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 7 月至 2006 年 8 月任上海涅柔斯投资管理有限公司美股交易员。2007 年 4 月加入海富通基金管理有限公司，历任交易员、高级交易员、量化分析师、投资经理、基金经理助理。2018 年 11 月起任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通富祥混合、海富通沪深 300 增强（原海富通富睿混合）、海富通量化多因子混合及海富通欣益混合的基金经理。2020 年 10 月起兼任海富通欣享混合、海富通新内需混合的基金经理。

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：自参加证券行业的相关工作开始计算。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资

组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

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

本报告期，基金在控制回撤的基础上，力图寻找合适的股票投资机会以赚取绝对收益。同时，

本基金积极参与新股申购，以增强投资收益。

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

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

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

本基金债券部分上半年在严格控制风险的前提下，以精选信用债配置策略为主，追求获得稳定票息收益。并适度结合基本面和资金面情况进行利率债波段交易以增厚收益。整体来看，债券部分规避了信用风险，获得了稳定较高收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通欣益灵活配置混合 A 净值增长率为 3.72%，同期业绩比较基准收益率为 1.75%，基金净值跑赢业绩比较基准 1.97 个百分点。海富通欣益灵活配置混合 C 净值增长率为 3.64%，同期业绩比较基准收益率为 1.75%，基金净值跑赢业绩比较基准 1.89 个百分点。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

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

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

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括分管基金运营业务的高级管理人员、分管投资业务的高级管理人员、督察稽核部负责人、风险管理部负责人、研究部负责人及基金运营部负责人等，以上人员具有丰富的合规、风控、证券研究、会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会对经济环境发生重大变化或发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金运营部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%。

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，基金托管人在海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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，海富通基金管理有限公司在海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

### 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

本报告期内，由海富通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：海富通欣益灵活配置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	5,386,722.33	6,137,156.74
结算备付金		11,890,578.85	1,097,365.90
存出保证金		102,275.09	3,299,903.59
交易性金融资产	6.4.7.2	1,022,675,427.03	507,784,978.71
其中：股票投资		244,086,198.12	146,149,848.12
基金投资		-	-
债券投资		778,589,228.91	361,635,130.59
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	-	4,000,000.00
应收证券清算款		1,513,340.79	404,775.46
应收利息	6.4.7.5	13,070,118.24	6,085,023.79
应收股利		-	-
应收申购款		510,805.12	55,890.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,055,149,267.45	528,865,094.40
<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		11,000,000.00	-



应付证券清算款		-	3,101,848.48
应付赎回款		2,897,137.85	199,290.32
应付管理人报酬		493,522.41	262,589.83
应付托管费		123,380.60	65,647.48
应付销售服务费		72,570.56	34,239.20
应付交易费用	6.4.7.7	209,723.43	164,483.08
应交税费		31,036.22	28,821.85
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	90,890.97	180,000.26
负债合计		14,918,262.04	4,036,920.50
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	712,283,119.77	376,558,592.94
未分配利润	6.4.7.10	327,947,885.64	148,269,580.96
所有者权益合计		1,040,231,005.41	524,828,173.90
负债和所有者权益总计		1,055,149,267.45	528,865,094.40

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 712,283,119.77 份，其中海富通欣益混合基金 A 类份额 435,787,142.32 份，海富通欣益混合基金 C 类份额 276,495,977.45 份。A 类份额净值 1.339 元，C 类份额净值 1.652 元。

## 6.2 利润表

会计主体：海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>28,707,476.73</b>	<b>14,603,274.10</b>
1.利息收入		10,773,894.82	5,218,905.41
其中：存款利息收入	6.4.7.11	147,442.89	49,544.80
债券利息收入		9,891,758.98	4,994,298.65
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		734,692.95	175,061.96
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		18,775,770.76	11,402,803.71
其中：股票投资收益	6.4.7.12	21,764,732.64	11,099,145.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,023,537.23	-495,174.16
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	-3,596,240.00	-304,966.60
股利收益	6.4.7.16	1,630,815.35	1,103,799.04
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-890,926.68	-2,035,252.09
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	48,737.83	16,817.07
<b>减：二、费用</b>		<b>4,527,430.51</b>	<b>1,694,718.75</b>
1. 管理人报酬		2,513,221.64	979,332.51
2. 托管费		628,305.38	244,833.15
3. 销售服务费		355,734.30	74,669.26
4. 交易费用	6.4.7.19	873,161.63	228,214.39
5. 利息支出		23,756.82	37,434.13
其中：卖出回购金融资产支出		23,756.82	37,434.13
6.税金及附加		21,507.27	19,302.45
7. 其他费用	6.4.7.20	111,743.47	110,932.86
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>24,180,046.22</b>	<b>12,908,555.35</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>24,180,046.22</b>	<b>12,908,555.35</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通欣益灵活配置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）	376,558,592.94	148,269,580.96	524,828,173.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	24,180,046.22	24,180,046.22
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）	335,724,526.83	155,498,258.46	491,222,785.29
其中：1.基金申购款	473,263,101.63	226,851,863.21	700,114,964.84
2.基金赎回款	-137,538,574.80	-71,353,604.75	-208,892,179.55
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）	712,283,119.77	327,947,885.64	1,040,231,005.41
项目	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	280,161,246.90	44,892,737.09	325,053,983.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,908,555.35	12,908,555.35
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）	11,736,706.28	3,425,321.72	15,162,028.00
其中：1.基金申购款	44,752,377.18	15,413,864.68	60,166,241.86
2.基金赎回款	-33,015,670.90	-11,988,542.96	-45,004,213.86
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）	291,897,953.18	61,226,614.16	353,124,567.34

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

海富通欣益灵活配置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[2016]第 939 号《关于准予海富通欣益灵活配置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《海富通欣益灵活配置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 400,035,458.76 元，业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(2016)第 1161 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 400,125,466.20 份，其中认购资金利息折合 90,007.44 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《海富通欣益灵活配置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《海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、权证、股指期货等权益类品种，债券等固定收益类品种(包括但不限于国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具等)，国债期货，以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。本基金股票投资及存托凭证占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。股指期货、国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%。

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》、《海富通欣益灵活配置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 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期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	5,386,722.33
定期存款	-
其他存款	-
合计	5,386,722.33

### 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	224,983,317.07	244,086,198.12	19,102,881.05
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	238,624,360.49	238,735,828.91
	银行间市场	538,542,661.64	539,853,400.00
	合计	777,167,022.13	778,589,228.91
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,002,150,339.20	1,022,675,427.03	20,525,087.83

### 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	4,899.52
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	33,796.53
应收债券利息	13,027,330.83
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	4,049.96
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	41.40
合计	13,070,118.24

**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	205,525.82
银行间市场应付交易费用	4,197.61
合计	209,723.43

**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	1,630.82
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,260.15

合计	90,890.97
----	-----------

#### 6.4.7.9 实收基金

海富通欣益混合 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	248,541,538.70	248,541,538.70
本期申购	236,816,451.92	236,816,451.92
本期赎回（以“-”号填列）	-49,570,848.30	-49,570,848.30
本期末	435,787,142.32	435,787,142.32

海富通欣益混合 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	128,017,054.24	128,017,054.24
本期申购	236,446,649.71	236,446,649.71
本期赎回（以“-”号填列）	-87,967,726.50	-87,967,726.50
本期末	276,495,977.45	276,495,977.45

注：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

海富通欣益混合 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	56,502,428.05	15,765,311.91	72,267,739.96
本期利润	14,637,812.52	-246,937.46	14,390,875.06
本期基金份额交易产生的变动数	45,820,300.48	15,301,944.73	61,122,245.21
其中：基金申购款	58,778,430.31	18,468,509.24	77,246,939.55
基金赎回款	-12,958,129.83	-3,166,564.51	-16,124,694.34
本期已分配利润	-	-	-



本期末	116,960,541.05	30,820,319.18	147,780,860.23
-----	----------------	---------------	----------------

海富通欣益混合 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	66,265,589.41	9,736,251.59	76,001,841.00
本期利润	10,433,160.38	-643,989.22	9,789,171.16
本期基金份额交易产生的变动数	79,947,527.70	14,428,485.55	94,376,013.25
其中：基金申购款	127,325,957.02	22,278,966.64	149,604,923.66
基金赎回款	-47,378,429.32	-7,850,481.09	-55,228,910.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	156,646,277.49	23,520,747.92	180,167,025.41

## 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	50,769.02
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	74,195.32
其他	22,478.55
合计	147,442.89

## 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	296,726,285.62
减：卖出股票成本总额	274,961,552.98
买卖股票差价收入	21,764,732.64

## 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	306,470,605.66
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	302,762,494.43

减：应收利息总额	4,731,648.46
买卖债券差价收入	-1,023,537.23

#### 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1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益（税前）	-3,596,240.00
买卖股指期货价差收入应缴纳增值税	-
合计	-3,596,240.00

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,630,815.35
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,630,815.35

#### 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	-2,847,466.68
——股票投资	-4,747,833.10
——债券投资	1,900,366.42
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	1,956,540.00
——权证投资	-
——股指期货	1,956,540.00
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	-890,926.68

**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	39,756.36
转换费收入	8,981.47
合计	48,737.83

**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	864,844.13
银行间市场交易费用	8,317.50
合计	873,161.63

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,033.32
其他费用	600.00
债券托管账户维护费	17,850.00
合计	111,743.47

**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**

截至本财务报表批准报出日，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
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例
海通证券	26,183,358.64	3.93%	27,283,977.44	21.15%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
海通证券	19,147.19	3.98%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
海通证券	24,864.17	22.62%	8,537.84	18.65%

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

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,513,221.64	979,332.51
其中：支付销售机构的客户维护费	216,180.14	23,114.66

注：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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	628,305.38	244,833.15

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通欣益混合 A	海富通欣益混合 C	合计
交通银行	-	1,509.14	1,509.14
海富通基金	-	262,223.98	262,223.98
合计	-	263,733.12	263,733.12
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	海富通欣益混合A	海富通欣益混合C	合计
交通银行	-	1,847.76	1,847.76
海富通基金	-	64,625.06	64,625.06
合计	-	66,472.82	66,472.82

注：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 0.2% 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：

$$\text{日基金销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额对应的资产净值} \times 0.2\% \div \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间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。

##### 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

本基金本报告期及上年度可比期间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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	5,386,722.33	50,769.02	4,310,129.74	21,355.05

## 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	2,714	189,817.16
海通证券	300940	南极光	网下发行	3,068	39,147.68
海通证券	688687	凯因科技	网下发行	5,354	101,618.92
海通证券	688665	四方光电	网下发行	1,687	49,817.11
海通证券	688092	爱科科技	网下发行	1,137	21,728.07
海通证券	688626	翔宇医疗	网下发行	3,652	105,250.64
海通证券	688630	芯碁微装	网下发行	3,397	51,736.31
海通证券	688682	霍莱沃	网下发行	946	43,251.12
海通证券	300981	中红医疗	网下发行	6,003	291,685.77
海通证券	688217	睿昂基因	网下发行	1,040	19,156.80
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

## 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

## 6.4.11 利润分配情况

本基金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	24.60	163.00	537	13,210.20	87,531.00	-

300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股锁定	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股锁定	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股锁定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股锁定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股锁定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股锁定	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	4
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股锁定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股锁定	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股锁定	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股锁定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股锁定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股锁定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新股锁定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股锁定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股锁定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-



300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股锁定	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股锁定	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股锁定	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新股锁定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股锁定	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股锁定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股锁定	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股未上市并锁定	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
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	-
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	-
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	-

60516 2	新中 港	2021-0 6-29	2021-0 7-07	新股 未上 市	6.07	6.07	1,377	8,358. 39	8,358. 39	-
68807 6	诺泰 生物	2021-0 5-12	2021-1 1-22	新股 锁定	15.57	48.55	4,984	77,600 .88	241,97 3.20	-
68808 3	中望 软件	2021-0 3-04	2021-0 9-13	新股 锁定	150.50	524.08	1,837	276,46 8.50	962,73 4.96	-
68808 7	英科 再生	2021-0 6-30	2021-0 7-09	新股 未上 市	21.96	21.96	2,469	54,219 .24	54,219 .24	-
68822 6	威腾 电气	2021-0 6-28	2021-0 7-07	新股 未上 市	6.42	6.42	2,693	17,289 .06	17,289 .06	-
68826 0	昀冢 科技	2021-0 3-25	2021-1 0-08	新股 锁定	9.63	16.41	2,990	28,793 .70	49,065 .90	-
68839 5	正弦 电气	2021-0 4-21	2021-1 0-29	新股 锁定	15.95	22.37	1,627	25,950 .65	36,395 .99	-
68862 1	阳光 诺和	2021-0 6-11	2021-1 2-21	新股 锁定	26.89	63.99	1,485	39,931 .65	95,025 .15	-
68862 6	翔宇 医疗	2021-0 3-23	2021-1 0-08	新股 锁定	28.82	104.16	3,652	105,25 0.64	380,39 2.32	-
68868 2	霍莱 沃	2021-0 4-13	2021-1 0-20	新股 锁定	45.72	103.85	946	43,251 .12	98,242 .10	-

**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
11305 0	南银 转债	2021-0 6-17	2021-0 7-01	老股 东配 债	100.00	100.00	2,910	291,00 0.00	291,00 0.00	-
11305 0	南银 转债	2021-0 6-17	2021-0 7-01	新债 未上 市	100.00	100.00	2,250	225,00 0.00	225,00 0.00	-
12311 7	健帆 转债	2021-0 6-23	2021-0 7-12	老股 东配 债	100.00	100.00	200	20,000 .00	20,000 .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 日中签新股数量 2,153 股，其中锁定流通受限数量 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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021-06-30	并购重组待审核停牌	56.35	2021-07-01	59.49	33,500	1,615,668.33	1,887,725.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款总额 11,000,000.00 元，于 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

本基金是一只混合型的证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股

票投资、债券投资及权证投资等。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以上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“风险和收益相匹配”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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行,因而与银行存款相关的信用风险不重大。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,本基金持有的除国债、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 55.57%(2020 年 12 月 31 日: 54.49%)。

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

**6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
A-1	30,036,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	96,718,400.00	35,942,008.50
合计	126,754,400.00	35,942,008.50

注：未评级部分为政策性金融债、国债和短期融资券。

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	117,099,000.00	48,827,000.00
合计	117,099,000.00	48,827,000.00

**6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
AAA	340,485,734.50	208,126,331.64
AAA 以下	38,304,544.41	18,987,790.45
未评级	155,945,550.00	49,752,000.00
合计	534,735,828.91	276,866,122.09

注：未评级部分为国债、政策性金融债。

**6.4.13.3 流动性风险**

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

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

于 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 11,000,000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股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该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.48%。

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,386,722.33	-	-	-	5,386,722.33
结算备付金	11,890,578.85	-	-	-	11,890,578.85
存出保证金	102,275.09	-	-	-	102,275.09
交易性金融资产	426,744,138.20	281,384,566.30	70,460,524.41	244,086,198.12	1,022,675,427.03
应收利息	-	-	-	13,070,118.24	13,070,118.24
应收申购款	-	-	-	510,805.12	510,805.12
应收证券清算款	-	-	-	1,513,340.79	1,513,340.79
资产总计	444,123,714.47	281,384,566.30	70,460,524.41	259,180,462.27	1,055,149,267.45
负债					
卖出回购金融资产	11,000,000.00	-	-	-	11,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	2,897,137.85	2,897,137.85
应付管理人报酬	-	-	-	493,522.41	493,522.41

应付托管费	-	-	-	123,380.60	123,380.60
应付销售服务费	-	-	-	72,570.56	72,570.56
应付交易费用	-	-	-	209,723.43	209,723.43
应交税费	-	-	-	31,036.22	31,036.22
其他负债	-	-	-	90,890.97	90,890.97
负债总计	11,000,000.00	-	-	3,918,262.04	14,918,262.04
利率敏感度缺口	433,123,714.47	281,384,566.30	70,460,524.41	255,262,200.23	1,040,231,005.41
<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	6,137,156.74	-	-	-	6,137,156.74
结算备付金	1,097,365.90	-	-	-	1,097,365.90
存出保证金	3,299,903.59	-	-	-	3,299,903.59
交易性金融资产	186,958,461.20	134,801,784.70	39,874,884.69	146,149,848.12	507,784,978.71
买入返售金融资产	4,000,000.00	-	-	-	4,000,000.00
应收利息	-	-	-	6,085,023.79	6,085,023.79
应收申购款	-	-	-	55,890.21	55,890.21
应收证券清算款	-	-	-	404,775.46	404,775.46
资产总计	201,492,887.43	134,801,784.70	39,874,884.69	152,695,537.58	528,865,094.40
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,101,848.48	3,101,848.48
应付赎回款	-	-	-	199,290.32	199,290.32
应付管理人报酬	-	-	-	262,589.83	262,589.83
应付托管费	-	-	-	65,647.48	65,647.48
应付销售服务费	-	-	-	34,239.20	34,239.20
应付交易费用	-	-	-	164,483.08	164,483.08
应交税费	-	-	-	28,821.85	28,821.85
其他负债	-	-	-	180,000.26	180,000.26
负债总计	-	-	-	4,036,920.50	4,036,920.50
利率敏感度缺口	201,492,887.43	134,801,784.70	39,874,884.69	148,658,617.08	524,828,173.90



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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的	
		影响金额（单位：人民币元）	
	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日	
	市场利率上升 25 个基点	-3,863,021.24	-1,798,891.14
	市场利率下降 25 个基点	3,927,566.75	1,826,507.65

#### 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或银行间同业市场交易的股票、存托凭证和债券，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，采用“自上而下”的策略，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市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票及存托凭证投资比例为基金资产的 0%-95%，权证投资 0%-3%。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	244,086,198.12	23.46	146,149,848.12	27.85
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	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>244,086,198.12</b>	<b>23.46</b>	<b>146,149,848.12</b>	<b>27.85</b>

#### 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(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%	12,772,129.17	6,499,115.70
业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-12,772,129.17	-6,499,115.70	

#### 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	244,086,198.12	23.13

	其中：股票	244,086,198.12	23.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	778,589,228.91	73.79
	其中：债券	778,589,228.91	73.79
	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	17,277,301.18	1.64
8	其他各项资产	15,196,539.24	1.44
9	合计	1,055,149,267.45	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	329,413.18	0.03
B	采矿业	4,516,441.00	0.43
C	制造业	159,319,940.40	15.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,843,487.89	0.18
E	建筑业	430,116.00	0.04
F	批发和零售业	1,026,396.38	0.10
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	10,777,971.96	1.04
J	金融业	48,382,959.75	4.65
K	房地产业	4,182,332.00	0.40
L	租赁和商务服务业	4,131,860.00	0.40
M	科学研究和技术服务业	5,387,592.48	0.52

N	水利、环境和公共设施管理业	17,050.08	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	2,309,557.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	1,431,080.00	0.14
S	综合	-	-
	合计	244,086,198.12	23.46

### 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	600519	贵州茅台	5,960	12,257,932.00	1.18
2	000858	五粮液	28,200	8,400,498.00	0.81
3	600036	招商银行	141,255	7,654,608.45	0.74
4	300059	东方财富	169,980	5,573,644.20	0.54
5	601166	兴业银行	263,400	5,412,870.00	0.52
6	603259	药明康德	33,687	5,275,047.33	0.51
7	601318	中国平安	78,000	5,013,840.00	0.48
8	000333	美的集团	64,457	4,600,296.09	0.44
9	000001	平安银行	202,700	4,585,074.00	0.44
10	601888	中国中免	13,100	3,931,310.00	0.38
11	601012	隆基股份	43,680	3,880,531.20	0.37
12	000063	中兴通讯	109,000	3,622,070.00	0.35
13	002415	海康威视	54,000	3,483,000.00	0.33
14	600958	东方证券	328,900	3,285,711.00	0.32
15	600031	三一重工	111,234	3,233,572.38	0.31
16	002475	立讯精密	69,833	3,212,318.00	0.31
17	002142	宁波银行	81,900	3,191,643.00	0.31
18	600309	万华化学	29,100	3,166,662.00	0.30
19	601238	广汽集团	241,800	3,131,310.00	0.30
20	600690	海尔智家	116,300	3,013,333.00	0.29
21	002594	比亚迪	11,800	2,961,800.00	0.28
22	603501	韦尔股份	8,800	2,833,600.00	0.27
23	000568	泸州老窖	11,501	2,713,545.94	0.26
24	601377	兴业证券	279,700	2,701,902.00	0.26

25	300124	汇川技术	36,000	2,673,360.00	0.26
26	300750	宁德时代	4,900	2,620,520.00	0.25
27	601009	南京银行	228,300	2,401,716.00	0.23
28	300122	智飞生物	12,300	2,296,779.00	0.22
29	600104	上汽集团	102,015	2,241,269.55	0.22
30	600438	通威股份	51,300	2,219,751.00	0.21
31	002230	科大讯飞	32,600	2,203,108.00	0.21
32	002271	东方雨虹	38,050	2,104,926.00	0.20
33	000002	万科A	80,900	1,926,229.00	0.19
34	000661	长春高新	4,900	1,896,300.00	0.18
35	002624	完美世界	79,100	1,891,281.00	0.18
36	600460	士兰微	33,500	1,887,725.00	0.18
37	300454	深信服	7,100	1,842,308.00	0.18
38	002311	海大集团	21,800	1,778,880.00	0.17
39	300014	亿纬锂能	16,771	1,743,010.03	0.17
40	300760	迈瑞医疗	3,600	1,728,180.00	0.17
41	688036	传音控股	8,177	1,713,081.50	0.16
42	600399	抚顺特钢	94,300	1,710,602.00	0.16
43	600660	福耀玻璃	30,600	1,709,010.00	0.16
44	603882	金域医学	10,100	1,613,677.00	0.16
45	600900	长江电力	76,100	1,570,704.00	0.15
46	000830	鲁西化工	83,800	1,569,574.00	0.15
47	600028	中国石化	356,500	1,554,340.00	0.15
48	600926	杭州银行	101,200	1,492,700.00	0.14
49	600276	恒瑞医药	21,960	1,492,621.20	0.14
50	002179	中航光电	18,800	1,485,576.00	0.14
51	688519	南亚新材	37,118	1,401,575.68	0.13
52	603369	今世缘	25,800	1,397,328.00	0.13
53	300408	三环集团	32,800	1,391,376.00	0.13
54	300529	健帆生物	16,100	1,390,396.00	0.13
55	300274	阳光电源	11,900	1,369,214.00	0.13
56	002812	恩捷股份	5,800	1,357,780.00	0.13
57	688169	石头科技	1,059	1,335,399.00	0.13
58	002636	金安国纪	82,200	1,333,284.00	0.13
59	000733	振华科技	21,700	1,325,219.00	0.13
60	600887	伊利股份	35,345	1,301,756.35	0.13
61	600176	中国巨石	83,183	1,290,168.33	0.12
62	601225	陕西煤业	101,500	1,202,775.00	0.12
63	600919	江苏银行	166,600	1,182,860.00	0.11
64	002557	洽洽食品	27,438	1,182,577.80	0.11
65	002129	中环股份	30,100	1,161,860.00	0.11
66	000786	北新建材	29,400	1,153,950.00	0.11
67	002241	歌尔股份	26,900	1,149,706.00	0.11
68	600893	航发动力	21,500	1,143,585.00	0.11

69	603267	鸿远电子	8,300	1,061,736.00	0.10
70	600486	扬农化工	9,400	1,050,638.00	0.10
71	601211	国泰君安	61,000	1,045,540.00	0.10
72	600030	中信证券	41,400	1,032,516.00	0.10
73	300979	华利集团	9,246	1,028,699.40	0.10
74	601966	玲珑轮胎	23,218	1,015,555.32	0.10
75	002001	新和成	34,440	987,739.20	0.09
76	601838	成都银行	77,400	978,336.00	0.09
77	300413	芒果超媒	14,200	974,120.00	0.09
78	601799	星宇股份	4,300	970,596.00	0.09
79	688083	中望软件	1,837	962,734.96	0.09
80	600426	华鲁恒升	31,070	961,616.50	0.09
81	002555	三七互娱	39,800	955,996.00	0.09
82	600585	海螺水泥	23,075	947,228.75	0.09
83	603678	火炬电子	13,800	931,500.00	0.09
84	002430	杭氧股份	26,600	920,094.00	0.09
85	603899	晨光文具	10,200	862,512.00	0.08
86	600171	上海贝岭	28,200	858,126.00	0.08
87	601689	拓普集团	21,900	819,717.00	0.08
88	601398	工商银行	157,400	813,758.00	0.08
89	002460	赣锋锂业	6,600	799,194.00	0.08
90	603218	日月股份	29,400	796,152.00	0.08
91	688268	华特气体	10,589	796,081.02	0.08
92	000656	金科股份	136,300	789,177.00	0.08
93	002727	一心堂	23,300	771,463.00	0.07
94	002968	新大正	17,400	757,770.00	0.07
95	002050	三花智控	31,200	748,176.00	0.07
96	601899	紫金矿业	74,300	719,967.00	0.07
97	000776	广发证券	47,500	719,150.00	0.07
98	600048	保利地产	58,900	709,156.00	0.07
99	300347	泰格医药	3,600	695,880.00	0.07
100	002138	顺络电子	17,700	686,229.00	0.07
101	002709	天赐材料	6,260	667,190.80	0.06
102	601233	桐昆股份	27,600	664,884.00	0.06
103	603986	兆易创新	3,500	657,650.00	0.06
104	601601	中国太保	22,500	651,825.00	0.06
105	601100	恒立液压	7,200	618,624.00	0.06
106	601288	农业银行	201,500	610,545.00	0.06
107	000739	普洛药业	20,200	593,880.00	0.06
108	603799	华友钴业	5,100	582,420.00	0.06
109	000983	山西焦煤	69,700	579,207.00	0.06
110	000596	古井贡酒	2,400	574,800.00	0.06
111	300316	晶盛机电	11,349	573,124.50	0.06
112	300496	中科创达	3,600	565,416.00	0.05

113	300628	亿联网络	6,700	561,460.00	0.05
114	300207	欣旺达	16,900	550,264.00	0.05
115	300751	迈为股份	1,200	545,640.00	0.05
116	002223	鱼跃医疗	14,000	533,820.00	0.05
117	603987	康德莱	20,200	525,200.00	0.05
118	600703	三安光电	16,200	519,210.00	0.05
119	000932	华菱钢铁	78,500	518,100.00	0.05
120	600406	国电南瑞	22,280	517,787.20	0.05
121	002653	海思科	23,700	510,024.00	0.05
122	603156	养元饮品	17,300	494,434.00	0.05
123	600862	中航高科	15,900	489,402.00	0.05
124	000425	徐工机械	76,400	486,668.00	0.05
125	688111	金山办公	1,229	485,209.20	0.05
126	600745	闻泰科技	5,000	484,500.00	0.05
127	600885	宏发股份	7,700	482,790.00	0.05
128	603416	信捷电气	7,600	482,372.00	0.05
129	600845	宝信软件	9,360	476,424.00	0.05
130	300482	万孚生物	7,300	472,237.00	0.05
131	002371	北方华创	1,700	471,546.00	0.05
132	300144	宋城演艺	27,200	456,960.00	0.04
133	603816	顾家家居	5,900	455,952.00	0.04
134	000651	格力电器	8,700	453,270.00	0.04
135	601117	中国化学	49,100	430,116.00	0.04
136	002332	仙琚制药	33,200	416,328.00	0.04
137	600563	法拉电子	2,600	411,736.00	0.04
138	002791	坚朗五金	2,100	407,505.00	0.04
139	000338	潍柴动力	22,743	406,417.41	0.04
140	002867	周大生	20,400	403,308.00	0.04
141	300724	捷佳伟创	3,400	394,434.00	0.04
142	002353	杰瑞股份	8,800	393,360.00	0.04
143	688626	翔宇医疗	3,652	380,392.32	0.04
144	688002	睿创微纳	3,781	377,457.23	0.04
145	300570	太辰光	23,400	374,400.00	0.04
146	002541	鸿路钢构	6,300	367,605.00	0.04
147	600521	华海药业	17,400	363,312.00	0.03
148	688089	XD 嘉必优	7,784	357,285.60	0.03
149	688526	科前生物	9,357	338,910.54	0.03
150	002714	牧原股份	5,320	323,562.40	0.03
151	603129	春风动力	2,600	322,608.00	0.03
152	603290	斯达半导	1,000	320,000.00	0.03
153	601666	平煤股份	43,600	309,996.00	0.03
154	605111	新洁能	1,680	302,853.60	0.03
155	603605	珀莱雅	1,500	295,065.00	0.03
156	603517	绝味食品	3,500	295,015.00	0.03

157	300782	卓胜微	540	290,250.00	0.03
158	603659	璞泰来	2,100	286,860.00	0.03
159	600499	科达制造	19,700	283,680.00	0.03
160	603833	欧派家居	1,960	278,241.60	0.03
161	002459	晶澳科技	5,500	269,500.00	0.03
162	000538	云南白药	2,300	266,156.00	0.03
163	002092	中泰化学	25,700	263,939.00	0.03
164	603456	九洲药业	5,300	257,474.00	0.02
165	600522	中天科技	25,700	257,000.00	0.02
166	603179	新泉股份	7,700	253,176.00	0.02
167	600803	新奥股份	15,250	251,777.50	0.02
168	300450	先导智能	4,160	250,182.40	0.02
169	002705	新宝股份	9,500	249,375.00	0.02
170	605068	明新旭腾	6,800	244,596.00	0.02
171	603195	公牛集团	1,200	242,400.00	0.02
172	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.02
173	603113	金能科技	13,200	238,392.00	0.02
174	000547	航天发展	12,600	237,762.00	0.02
175	600372	中航电子	14,100	233,355.00	0.02
176	300394	天孚通信	9,180	232,437.60	0.02
177	600219	南山铝业	64,500	232,200.00	0.02
178	300659	中孚信息	6,900	231,633.00	0.02
179	300737	科顺股份	7,100	223,224.00	0.02
180	002389	航天彩虹	10,200	222,666.00	0.02
181	002410	广联达	3,200	218,240.00	0.02
182	002444	巨星科技	6,300	214,704.00	0.02
183	603233	大参林	4,080	208,528.80	0.02
184	600138	中青旅	19,100	200,550.00	0.02
185	601877	正泰电器	5,900	196,942.00	0.02
186	600298	安琪酵母	3,600	195,768.00	0.02
187	300702	天宇股份	5,220	184,892.40	0.02
188	603896	寿仙谷	4,400	179,256.00	0.02
189	688109	品茗股份	2,295	178,183.80	0.02
190	603993	洛阳钼业	29,100	150,156.00	0.01
191	601677	明泰铝业	7,600	148,580.00	0.01
192	002508	老板电器	3,000	139,500.00	0.01
193	300775	三角防务	3,100	118,420.00	0.01
194	300502	新易盛	3,781	118,156.25	0.01
195	300138	晨光生物	7,000	107,100.00	0.01
196	300451	创业慧康	11,420	100,952.80	0.01
197	688682	霍莱沃	946	98,242.10	0.01
198	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.01
199	300919	中伟股份	537	87,531.00	0.01
200	002632	道明光学	12,700	86,487.00	0.01



201	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
202	600761	安徽合力	5,200	57,512.00	0.01
203	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.01
204	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
205	688260	昀冢科技	2,990	49,065.90	0.00
206	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
207	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
208	688395	正弦电气	1,627	36,395.99	0.00
209	002955	鸿合科技	1,900	36,271.00	0.00
210	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
211	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
212	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
213	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
214	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
215	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
216	002967	广电计量	400	17,520.00	0.00
217	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
218	688122	西部超导	261	16,931.07	0.00
219	300395	菲利华	300	14,466.00	0.00
220	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
221	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
222	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
223	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
224	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
225	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
226	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
227	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
228	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
229	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
230	603700	宁水集团	400	9,676.00	0.00
231	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
232	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
233	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
234	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
235	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
236	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
237	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
238	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
239	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
240	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
241	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
242	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
243	600461	洪城环境	1,100	7,986.00	0.00
244	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00

245	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
246	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
247	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
248	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
249	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
250	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
251	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
252	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
253	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
254	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
255	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
256	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
257	603185	上机数控	20	3,579.00	0.00
258	300188	美亚柏科	3	52.20	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	300059	东方财富	13,259,544.76	2.53
2	600276	恒瑞医药	9,445,379.96	1.80
3	600519	贵州茅台	8,387,723.60	1.60
4	601318	中国平安	6,141,472.00	1.17
5	000858	五粮液	5,811,545.00	1.11
6	601899	紫金矿业	5,195,059.00	0.99
7	300122	智飞生物	5,089,646.05	0.97
8	002594	比亚迪	4,987,716.00	0.95
9	601238	广汽集团	4,583,350.00	0.87
10	002230	科大讯飞	4,463,895.00	0.85
11	603259	药明康德	4,225,969.58	0.81
12	601377	兴业证券	4,188,163.66	0.80
13	000333	美的集团	4,121,622.00	0.79
14	000063	中兴通讯	3,996,581.00	0.76
15	601166	兴业银行	3,791,755.00	0.72
16	600690	海尔智家	3,790,354.00	0.72
17	300014	亿纬锂能	3,574,739.00	0.68
18	002475	立讯精密	3,518,896.00	0.67
19	600958	东方证券	3,401,669.00	0.65
20	002142	宁波银行	3,370,167.36	0.64

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	300059	东方财富	12,094,147.92	2.30
2	600519	贵州茅台	11,257,450.30	2.14
3	601318	中国平安	7,884,968.00	1.50
4	601899	紫金矿业	6,953,870.00	1.32
5	600276	恒瑞医药	6,629,580.00	1.26
6	002594	比亚迪	4,888,024.47	0.93
7	300122	智飞生物	4,135,991.00	0.79
8	300014	亿纬锂能	3,959,610.00	0.75
9	000725	京东方 A	3,292,210.00	0.63
10	600438	通威股份	3,216,458.63	0.61
11	002230	科大讯飞	2,848,358.00	0.54
12	300316	晶盛机电	2,837,844.34	0.54
13	600030	中信证券	2,799,388.00	0.53
14	000100	TCL 科技	2,797,293.00	0.53
15	000002	万 科 A	2,634,491.00	0.50
16	002475	立讯精密	2,583,242.00	0.49
17	000333	美的集团	2,548,367.00	0.49
18	002352	顺丰控股	2,412,655.00	0.46
19	002241	歌尔股份	2,401,089.00	0.46
20	002027	分众传媒	2,388,274.00	0.46

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	377,645,736.08
卖出股票的收入（成交）总额	296,726,285.62

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	90,524,550.00	8.70

2	央行票据	-	-
3	金融债券	161,272,000.00	15.50
	其中：政策性金融债	110,020,000.00	10.58
4	企业债券	188,786,000.00	18.15
5	企业短期融资券	82,155,400.00	7.90
6	中期票据	116,958,000.00	11.24
7	可转债（可交换债）	11,782,278.91	1.13
8	同业存单	117,099,000.00	11.26
9	其他	10,012,000.00	0.96
10	合计	778,589,228.91	74.85

#### 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	019640	20 国债 10	445,990	44,599,000.00	4.29
2	210205	21 国开 05	400,000	40,500,000.00	3.89
3	112427	16 滨房 01	400,000	40,080,000.00	3.85
4	112014114	20 江苏银行 CD114	400,000	38,860,000.00	3.74
5	101575003	15 沪城控 MTN001(7 年期)	300,000	30,603,000.00	2.94

#### 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

本基金的股指期货投资用于套期保值。在预期市场上涨时，可以通过买入股指期货作为股票替代，增加股票仓位，同时提高资金的利用效率；在预期市场下跌时，可以通过卖出股指期货对冲股市整体下跌的系统性风险，对投资组合的价值进行保护。

## 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

本基金的国债期货投资以风险管理为原则，以套期保值为目的。管理人按照相关法律法规的规定，结合国债现货市场和期货市场的波动性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行操作，获取超额收益。

### 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 20 兴业银行 CD311 (112010311) 的发行人，因同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权等违规行为，于 2020 年 8 月 31 日被中国银保监会福建监管局没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元。因为无证机构提供转接清算服务、为支付机构超范围经营提供支付服务、违规连通上下游支付机构提供转接清算服务等，且上述违规行为未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定等行为，于 2020 年 9 月 4 日被中国人民银行福州中心支行给予警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款。因在为永城煤电控股集团有限公司提供中介服务过程中，存在违反银行间债券市场相关自律管理规则的行为，于 2021 年 1 月 15 日被中国银行间市场交易商协会通报批评，责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。对该证券的投资决策程序的说明：公司整体信用水平高，为全国大型银行，综合实力强，信用风险可控。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

报告期内本基金投资的 20 国开 12(200212)、21 国开 05 (210205) 的发行人，因为违规的政府购买

服务项目提供融资、项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况、违规变相发放土地储备贷款等违规行为于 2020 年 12 月 25 日被中国银行保险监督管理委员会处罚 4880 万元。

对该证券的投资决策程序的说明：公司整体信用水平高，为全国大型政策银行，综合实力强，信用风险可控。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

其余七名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	102,275.09
2	应收证券清算款	1,513,340.79
3	应收股利	-
4	应收利息	13,070,118.24
5	应收申购款	510,805.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,196,539.24

### 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	132007	16 凤凰 EB	7,692,988.20	0.74
2	132008	17 山高 EB	1,046,200.00	0.10
3	113011	光大转债	577,900.00	0.06
4	110059	浦发转债	512,150.00	0.05
5	110061	川投转债	441,436.30	0.04
6	128075	远东转债	354,360.00	0.03
7	113545	金能转债	346,660.00	0.03
8	132021	19 中电 EB	214,060.00	0.02
9	110077	洪城转债	2,299.80	0.00

10	128135	洽洽转债	1,484.60	0.00
----	--------	------	----------	------

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中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
海富通欣益混合 A	5,567	78,280.43	395,471,142.09	90.75%	40,316,000.23	9.25%
海富通欣益混合 C	5,299	52,178.90	261,434,183.84	94.55%	15,061,793.61	5.45%
合计	10,866	65,551.55	656,905,325.93	92.23%	55,377,793.84	7.77%

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	海富通欣益混合 A	2,435,723.38	0.5589%
	海富通欣益混合 C	649,087.46	0.2348%
	合计	3,084,810.84	0.4331%

### 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	海富通欣益混合 A	>100
	海富通欣益混合 C	50~100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通欣益混合 A	0~10
	海富通欣益混合 C	0

	合计	0~10
--	----	------

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通欣益混合 A	海富通欣益混合 C
基金合同生效日（2016 年 9 月 7 日）基金份额总额	350,101,283.31	50,024,182.89
本报告期期初基金份额总额	248,541,538.70	128,017,054.24
本报告期基金总申购份额	236,816,451.92	236,446,649.71
减：本报告期基金总赎回份额	49,570,848.30	87,967,726.50
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	435,787,142.32	276,495,977.45

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

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

#### 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----



	单元数量	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	
太平洋证券	2	204,503,094.13	30.69%	148,096.93	30.78%	-
国金证券	1	101,197,364.93	15.18%	71,982.27	14.96%	-
国泰君安	2	76,684,738.21	11.51%	55,389.48	11.51%	-
光大证券	1	73,455,311.79	11.02%	52,249.14	10.86%	-
兴业证券	2	73,360,896.17	11.01%	53,647.86	11.15%	-
长江证券	1	73,351,538.00	11.01%	53,642.12	11.15%	-
海通证券	1	26,183,358.64	3.93%	19,147.19	3.98%	-
招商证券	1	22,545,213.11	3.38%	16,036.62	3.33%	-
华泰证券	1	7,757,024.00	1.16%	5,672.73	1.18%	-
国元证券	2	7,418,066.70	1.11%	5,276.60	1.10%	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
申万宏源（原申万）	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元没有发生变更。

#### 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

太平洋证券	17,875,887.90	14.62%	1,134,500,000.00	41.49%	-	-
国金证券	-	-	10,000,000.00	0.37%	-	-
国泰君安	52,201.20	0.04%	609,800,000.00	22.30%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	29,690,643.90	24.28%	665,000,000.00	24.32%	-	-
长江证券	35,467.00	0.03%	228,000,000.00	8.34%	-	-
海通证券	60,639,403.14	49.60%	47,000,000.00	1.72%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	13,596,040.60	11.12%	40,000,000.00	1.46%	-	-
国元证券	372,557.45	0.31%	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申万宏源（原申万）	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	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	2021-01-01
2	海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金调整大额申购和转换转入业务金额限额的公告	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	2021-01-05
3	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加平安银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	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	2021-01-05
4	海富通基金管理有限公司关于旗下海富通欣享灵活配置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开通定期定额	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	2021-01-09

	投资业务的公告		
5	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加国泰君安证券股份有限公司申购及定期定额投资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	2021-01-12
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增长江证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	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	2021-01-18
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	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	2021-01-19
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	2021-01-19
9	海富通基金管理有限公司关于海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金新增上海基煜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	2021-01-20
10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海联泰基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	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	2021-01-28
11	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	2021-01-29
12	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	2021-02-02
13	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	2021-02-04
14	海富通基金管理有限公司关于海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金新增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	2021-03-04
15	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国泰君安证券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	2021-03-09
16	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	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	2021-03-16
17	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和耕传承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	2021-03-17
18	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

19	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
20	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
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	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	2021-03-25
22	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	2021-03-29
23	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	2021-04-12
24	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	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	2021-04-13
25	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	2021-04-15
26	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	2021-04-21
27	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加招商银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	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	2021-05-06
28	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
29	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增平安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	2021-06-16

## §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	2021/1/1-2021/1/24	98,665,788.35	-	38,000,000.00	60,665,788.35	8.52%

产品特有风险
<p>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：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>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；</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>4、其他可能的风险。</li> </ol> <p>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。</p>



## 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益灵活配置混合型证券投资基金的文件
- (二) 海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (三) 海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- (四) 海富通欣益灵活配置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) 报告期内海富通欣益灵活配置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