

# 海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）

## 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

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

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	14
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
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	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	19
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44
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	44
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	44
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	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§8 基金份额持有人信息	46

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	46
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
8.4 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 .....	47
§9 开放式基金份额变动 .....	48
§10 重大事件揭示 .....	48
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4 基金投资策略的改变 .....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
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 .....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.8 其他重大事件 .....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
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 .....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
§12 备查文件目录 .....	52
12.1 备查文件目录 .....	52
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	53



## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）	
基金简称	海富通中证 100 指数（LOF）	
场内简称	海富 100LOF	
基金主代码	162307	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 10 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	
报告期末基金份额总额	54,591,124.53 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2010 年 1 月 8 日	
下属分级基金的基金简称	海富通中证 100 指数 A	海富通中证 100 指数 C
下属分级基金的交易代码	162307	010224
报告期末下属分级基金的份额总额	54,572,263.28 份	18,861.25 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资方式，通过有效的投资程序约束和数量化风险管理手段，控制基金投资组合相对于业绩比较基准的偏离度，实现对业绩比较基准的有效跟踪。
投资策略	本基金采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	中证 100 指数×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是股票型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。

### 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	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	《上海证券报》
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	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)	
	海富通中证 100 指数 A	海富通中证 100 指数 C
本期已实现收益	4,919,649.01	792.37
本期利润	724,268.36	323.89
加权平均基金份额本期利润	0.0129	0.0443
本期加权平均净值利润率	0.78%	2.72%
本期基金份额净值增长率	0.43%	0.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	海富通中证 100 指数 A	海富通中证 100 指数 C
期末可供分配利润	34,193,101.85	11,793.61

期末可供分配基金份额利润	0.6266	0.6253
期末基金资产净值	88,765,365.13	30,654.86
期末基金份额净值	1.627	1.625
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2021 年 6 月 30 日)</b>	
	海富通中证 100 指数 A	海富通中证 100 指数 C
基金份额累计净值增长率	116.89%	6.28%

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。

## 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

海富通中证 100 指数 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	-2.69%	0.69%	-3.51%	0.73%	0.82%	-0.04%
过去三个月	1.43%	0.92%	-0.23%	0.96%	1.66%	-0.04%
过去六个月	0.43%	1.24%	-2.69%	1.28%	3.12%	-0.04%
过去一年	36.49%	1.25%	22.83%	1.27%	13.66%	-0.02%
过去三年	84.43%	1.27%	42.29%	1.29%	42.14%	-0.02%
自基金合同生效起至今	116.89%	1.37%	60.96%	1.37%	55.93%	0.00%

海富通中证 100 指数 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	-2.69%	0.70%	-3.51%	0.73%	0.82%	-0.03%
过去三个月	1.37%	0.92%	-0.23%	0.96%	1.60%	-0.04%
过去六个月	0.31%	1.24%	-2.69%	1.28%	3.00%	-0.04%
自基金合同生效起至今	6.28%	1.16%	2.33%	1.19%	3.95%	-0.03%

### 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

海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)

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

(2009 年 10 月 30 日至 2021 年 6 月 30 日)

海富通中证 100 指数 A





海富通中证 100 指数 C



注：按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。建仓期满至今，本基金投资组合均达到本基金合同第十五条（二）、（七）规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

#### §4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 87 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通可转债优选债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通富祥混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资

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

#### 4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
江勇	本基金的基金经理	2018-07-25	-	10 年	经济学硕士, 持有基金从业人员资格证书。历任国泰君安期货有限公司研究所高级分析师, 资产管理部研究员、交易员、投资经理。2017 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2018 年 7 月起任海富通上证周期 ETF、海富通上证周期 ETF 联接、海富通上证非周期 ETF、海富通上证非周期 ETF 联接、海富通中证 100 指数 (LOF) 基金经理。2018 年 7 月至 2020 年 3 月任海富通中证内地低碳指数 (现海富通中证 500 增强) 基金经理。2020 年 8 月起兼任海富通中证长三角领先 ETF、海富通中证长三角领

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

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

2、证券从业年限的计算标准：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间交易的样本，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。

报告期内, 本基金完成了年中的指数成分股调整。作为指数基金, 在操作上我们严格遵守基金合同, 应用指数复制策略和数量化手段提高组合与指数的拟合度, 降低跟踪误差。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内, 本基金 A 份额净值增长率为 0.43%, 同期业绩比较基准收益率为-2.69%; 本基金 C 份额净值增长率为 0.31%, 同期业绩比较基准收益率为-2.69%。

#### 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。

未来，本基金将继续严格按照基金合同的要求，秉承指数化投资策略，提高组合与指数的拟合度。

#### 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

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益分配每年至多 6 次，每次基金收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

### §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）（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合规守信、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：海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）

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	5,544,238.65	5,310,677.29
结算备付金		8,174.71	39,847.54
存出保证金		6,014.26	46,922.87
交易性金融资产	6.4.7.2	83,587,471.95	90,803,892.64
其中：股票投资		83,587,471.95	89,619,992.64
基金投资		-	-

债券投资		-	1,183,900.00
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		-	98,281.08
应收利息	6.4.7.5	472.86	22,661.99
应收股利		-	-
应收申购款		18,637.15	188,731.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>89,165,009.58</b>	<b>96,511,014.88</b>
<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		-	-
应付赎回款		158,342.79	653,075.72
应付管理人报酬		51,609.87	54,947.64
应付托管费		8,847.42	9,419.58
应付销售服务费		2.55	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,964.70	27,404.70
应交税费		-	0.41
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	144,222.26	281,941.28
<b>负债合计</b>		<b>368,989.59</b>	<b>1,026,789.33</b>
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	54,591,124.53	58,924,669.34
未分配利润	6.4.7.10	34,204,895.46	36,559,556.21
<b>所有者权益合计</b>		<b>88,796,019.99</b>	<b>95,484,225.55</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>89,165,009.58</b>	<b>96,511,014.88</b>

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 54,591,124.53 份，其中海富通中证 100A 类份额 54,572,263.28 份，海富通中证 100C 类份额 18,861.25 份。A 类份额净值 1.627 元，C 类份额净值 1.625 元。

## 6.2 利润表

会计主体：海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)



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>1,337,699.81</b>	<b>3,138,409.24</b>
1.利息收入		10,667.93	128,698.54
其中：存款利息收入	6.4.7.11	10,083.16	20,727.02
债券利息收入		584.77	107,971.52
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）		5,500,439.89	13,849,904.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,633,400.34	11,952,678.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	37,655.68	29,979.62
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	829,383.87	1,867,246.36
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-4,195,849.13	-10,918,725.90
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	22,441.12	78,532.60
<b>减：二、费用</b>		<b>613,107.56</b>	<b>1,095,375.91</b>
1. 管理人报酬		324,126.58	620,980.97
2. 托管费		55,564.54	106,453.87
3. 销售服务费		5.73	-
4. 交易费用	6.4.7.19	28,081.69	130,853.71
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.13	0.09
7. 其他费用	6.4.7.20	205,328.89	237,087.27
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>724,592.25</b>	<b>2,043,033.33</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>724,592.25</b>	<b>2,043,033.33</b>

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通中证 100 指数证券投资基金 (LOF)

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）	58,924,669.34	36,559,556.21	95,484,225.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	724,592.25	724,592.25
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）	-4,333,544.81	-3,079,253.00	-7,412,797.81
其中：1.基金申购款	8,214,136.73	5,427,834.76	13,641,971.49
2.基金赎回款	-12,547,681.54	-8,507,087.76	-21,054,769.30
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）	54,591,124.53	34,204,895.46	88,796,019.99
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）	170,873,343.91	43,672,968.37	214,546,312.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,043,033.33	2,043,033.33
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）	-28,341,285.31	-6,818,854.89	-35,160,140.20
其中：1.基金申购款	28,030,087.77	4,766,961.80	32,797,049.57
2.基金赎回款	-56,371,373.08	-11,585,816.69	-67,957,189.77
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）	-	-11,541,308.93	-11,541,308.93
五、期末所有者权益（基金净值）	142,532,058.60	27,355,837.88	169,887,896.48

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

海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF) (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[2009]第 879 号《关于核准海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》核准，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《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,086,432,233.85 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字 (2009)第 226 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2009 年 10 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,087,148,875.30 份基金份额，其中认购资金利息折合 716,641.45 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《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》和《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)招募说明书》并报中国证监会备案，自 2020 年 11 月 10 日起，本基金根据申购费用、赎回费用及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。在投资者申购时收取前端申购费用，不收取销售服务费的，称为 A 类基金份额；不收取前端申购费用，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。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2009]第 205 号文审核同意，本基金 107,647,812.00 份基金份额于 2010 年 1 月 8 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证 100 指数成份股及备选成份股、新股(首次公开发行股票或增发)、存托凭证、固定收益产品、权证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。其中股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 90%-95%，投资于相关标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产的 80%，现金、固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的

政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的基金管理人力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差小于 4%。本基金的业绩比较基准为：中证 100 指数×95%+活期存款利率(税后)×5%。

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

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金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》、《海富通中证 100 指数证券投资基金(LOF)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 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 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 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	5,544,238.65
定期存款	-
其他存款	-
合计	5,544,238.65

### 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	62,695,987.28	83,587,471.95	20,891,484.67
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	62,695,987.28	83,587,471.95	20,891,484.67

#### 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	467.08
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	3.33
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	0.02
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	2.43
合计	472.86

#### 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	5,964.70
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,964.70

**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	507.74
应付证券出借违约金	-
预提费用	93,714.52
应付指数使用费	50,000.00
合计	144,222.26

**6.4.7.9 实收基金****海富通中证 100 指数 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（份）	账面金额
上年度末	58,924,471.18	58,924,471.18
本期申购	8,195,467.29	8,195,467.29
本期赎回（以“-”号填列）	-12,547,675.19	-12,547,675.19
本期末	54,572,263.28	54,572,263.28

**海富通中证 100 指数 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（份）	账面金额
上年度末	198.16	198.16
本期申购	18,669.44	18,669.44
本期赎回（以“-”号填列）	-6.35	-6.35
本期末	18,861.25	18,861.25

注：截至 2021 年 6 月 30 日止，本基金 A 类份额于深交所上市的基金份额为 1,854,376.00 份（2020 年 12 月 31 日：1,853,081.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 52,717,887.28 份（2020 年 12

月 31 日: 57,071,390.18 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统, 可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回; 未上市的基金份额登记在注册登记系统, 按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 海富通中证 100 指数 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	41,306,104.94	-4,746,671.50	36,559,433.44
本期利润	4,919,649.01	-4,195,380.65	724,268.36
本期基金份额交易产生的变动数	-3,189,015.31	98,415.36	-3,090,599.95
其中: 基金申购款	6,019,147.90	-602,663.93	5,416,483.97
基金赎回款	-9,208,163.21	701,079.29	-8,507,083.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,036,738.64	-8,843,636.79	34,193,101.85

##### 海富通中证 100 指数 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	138.70	-15.93	122.77
本期利润	792.37	-468.48	323.89
本期基金份额交易产生的变动数	13,912.58	-2,565.63	11,346.95
其中: 基金申购款	13,917.33	-2,566.54	11,350.79
基金赎回款	-4.75	0.91	-3.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,843.65	-3,050.04	11,793.61

#### 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	9,877.17
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	60.16
其他	145.83
合计	10,083.16

#### 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	11,440,977.96
减：卖出股票成本总额	6,807,577.62
买卖股票差价收入	4,633,400.34

**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	1,454,262.64
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,394,000.00
减：应收利息总额	22,606.96
买卖债券差价收入	37,655.68

**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	829,383.87
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	829,383.87

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-4,195,849.13
——股票投资	-4,195,049.13
——债券投资	-800.00
——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	-4,195,849.13

**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	22,441.12
合计	22,441.12

**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	28,081.69
银行间市场交易费用	-
合计	28,081.69

**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	24,795.19
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行划款手续费	2,614.37
上市费	29,247.75
指数使用费	100,000.00
债券托管账户维护费	9,000.00
合计	205,328.89

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 50,000 元。

**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
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
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	1,761,030.19	12.25%	26,891,773.80	36.79%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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	1,287.81	14.04%	-	-
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	19,487.52	44.10%	18,603.71	100.00%

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

2. 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	324,126.58	620,980.97
其中：支付销售机构的客户维护费	78,677.42	78,975.76

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 0.7% 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 0.7% / 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	55,564.54	106,453.87

注：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 0.12% 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 0.12% / 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		
	海富通中证 100 指数 A	海富通中证 100 指数 C	合计
海富通基金	-	0.40	0.40
合计	-	0.40	0.40
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		
	海富通中证100指数 A	海富通中证100指数C	合计
合计	-	-	-

注：本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的基金销售服务费年费率为 0.10%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.10% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。销

售服务费的计算方法如下：日销售服务费 = 前一日 C 类份额的基金资产净值 × 0.10% / 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与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

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

本基金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
中国银行	5,544,238.65	9,877.17	7,512,321.20	17,863.68

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 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

本基金采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。相关的关联交易事项如下：

(1) 于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有 63,962 股海通证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 922,526.99 元，估值总额为人民币 735,563.00 元，占基金资产净值的比例为 0.82%（2020 年 12 月 31 日：持有 63,962 股，成本总额为人民币 922,526.99 元，估值总额为人民币 822,551.32 元，占基金资产净值的比例为 0.86%）。

(2) 于 2021 年 6 月 30 日, 本基金持有 148,576 托管人公司的 A 股普通股, 成本总额为人民币 605,400.45 元, 估值总额为人民币 457,614.08 元, 占基金资产净值的比例为 0.52% (2020 年 12 月 31 日: 持有 148,576 股, 成本总额为人民币 605,400.45 元, 估值总额为人民币 472,471.68 元, 占基金资产净值的比例为 0.49%)。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未实施利润分配。

#### 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
688070	纵横股份	2021-02-02	2021-08-10	新股锁定流通受限	23.16	34.47	1,445	33,466.20	49,809.15	-
688079	美迪凯	2021-02-23	2021-09-02	新股锁定流通受限	10.19	18.40	3,245	33,066.55	59,708.00	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	839	18,424.44	18,424.44	-
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	-
688319	欧林生物	2021-05-31	2021-12-08	新股锁定流通受限	9.88	27.34	1,974	19,503.12	53,969.16	-
688659	元琛科技	2021-03-24	2021-10-08	新股锁定流通受限	6.50	10.46	3,445	22,392.50	36,034.70	-
688662	富信科技	2021-03-25	2021-10-08	新股锁定流通受限	15.61	29.51	1,899	29,643.39	56,039.49	-

688700	东威科技	2021-06-07	2021-12-15	新股锁定流通受限	9.41	38.46	2,312	21,755.92	88,919.52	-
--------	------	------------	------------	----------	------	-------	-------	-----------	-----------	---

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

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

本基金是采用指数化操作的股票型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。本基金投资的金融工具主要为股票投资。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中国银行,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:本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.19%)。

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	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	999,900.00
合计	-	999,900.00

注:未评级部分为国债。

##### 6.4.13.2.2 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	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	181,000.00
AAA 以下	-	3,000.00
未评级	-	-
合计	-	184,000.00

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

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 0.43%。

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 2021 年 6 月 30 日，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、存出保证金及债券投资等。

##### 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	5,544,238.65	-	-	-	5,544,238.65
结算备付金	8,174.71	-	-	-	8,174.71
存出保证金	6,014.26	-	-	-	6,014.26
交易性金融资产	-	-	-	83,587,471.95	83,587,471.95
应收申购款	-	-	-	18,637.15	18,637.15
应收利息	-	-	-	472.86	472.86
资产总计	5,558,427.62	-	-	83,606,581.96	89,165,009.58
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	51,609.87	51,609.87
应付托管费	-	-	-	8,847.42	8,847.42
应付销售服务费	-	-	-	2.55	2.55
应付交易费用	-	-	-	5,964.70	5,964.70
应付赎回款	-	-	-	158,342.79	158,342.79
其他负债	-	-	-	144,222.26	144,222.26
负债总计	-	-	-	368,989.59	368,989.59
利率敏感度缺口	5,558,427.62	-	-	83,237,592.37	88,796,019.99
<b>上年度末</b>					
<b>2020 年 12 月 31</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>
<b>日</b>					
资产					
银行存款	5,310,677.29	-	-	-	5,310,677.29
结算备付金	39,847.54	-	-	-	39,847.54
存出保证金	46,922.87	-	-	-	46,922.87
交易性金融资产	999,900.00	-	184,000.00	89,619,992.64	90,803,892.64
应收证券清算款	-	-	-	98,281.08	98,281.08
应收申购款	-	-	-	188,731.47	188,731.47
应收利息	-	-	-	22,661.99	22,661.99
资产总计	6,397,347.70	-	184,000.00	89,929,667.18	96,511,014.88
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	54,947.64	54,947.64
应付托管费	-	-	-	9,419.58	9,419.58
应付交易费用	-	-	-	27,404.70	27,404.70
应交税费	-	-	-	0.41	0.41
应付赎回款	-	-	-	653,075.72	653,075.72
其他负债	-	-	-	281,941.28	281,941.28
负债总计	-	-	-	1,026,789.33	1,026,789.33
利率敏感度缺口	6,397,347.70	-	184,000.00	88,902,877.85	95,484,225.55

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	-	-2,667.19
	市场利率下降 25 个基点	-	2,711.62

#### 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，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。

本基金采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金以降低基金的跟踪误差为目的，在考虑流动性风险的前提下，构建债券投资组合。确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等类别资产间的分配比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整股票资产、债券资产和货币市场工具的比例，以规避或控制市场风险，提高基金收益率。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 90%-95%，投资于相关标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产的 80%。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	公允价值	占基金

		资产净 值比例 (%)		资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	83,587,471.95	94.13	89,619,992.64	93.86
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	83,587,471.95	94.13	89,619,992.64	93.86

#### 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
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	4,097,137.58	4,378,768.24
2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-4,097,137.58	-4,378,768.24	

#### 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	83,587,471.95	93.74
	其中: 股票	83,587,471.95	93.74
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	5,552,413.36	6.23
8	其他各项资产	25,124.27	0.03
9	合计	89,165,009.58	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

#### 7.2.1.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	1,220,026.24	1.37
B	采矿业	2,184,676.62	2.46
C	制造业	38,384,187.08	43.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,511,331.72	1.70
E	建筑业	1,408,777.60	1.59
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,967,162.84	2.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	923,131.40	1.04
J	金融业	28,411,952.91	32.00
K	房地产业	2,023,527.95	2.28
L	租赁和商务服务业	2,595,660.91	2.92
M	科学研究和技术服务业	1,623,525.12	1.83
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	89,827.00	0.10
Q	卫生和社会工作	217,198.80	0.24
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	82,560,986.19	92.98
--	----	---------------	-------

### 7.2.1.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	653,857.57	0.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,988.90	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	12,230.40	0.01
J	金融业	97,319.40	0.11
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	223,089.49	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	1,026,485.76	1.16

### 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

#### 7.3.1 期末指数投资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	3,948	8,119,851.60	9.14
2	601318	中国平安	77,456	4,978,871.68	5.61
3	600036	招商银行	82,113	4,449,703.47	5.01
4	600276	恒瑞医药	34,208	2,325,117.76	2.62
5	601166	兴业银行	112,588	2,313,683.40	2.61
6	000333	美的集团	29,607	2,113,051.59	2.38
7	601012	隆基股份	23,660	2,101,954.40	2.37
8	601888	中国中免	6,719	2,016,371.90	2.27
9	600887	伊利股份	46,900	1,727,327.00	1.95
10	300059	东方财富	51,188	1,678,454.52	1.89
11	603259	药明康德	10,368	1,623,525.12	1.83
12	002415	海康威视	23,597	1,522,006.50	1.71
13	000858	五粮液	5,076	1,512,089.64	1.70
14	002594	比亚迪	5,976	1,499,976.00	1.69
15	000651	格力电器	28,780	1,499,438.00	1.69
16	600030	中信证券	59,506	1,484,079.64	1.67
17	600900	长江电力	67,648	1,396,254.72	1.57
18	002475	立讯精密	29,408	1,352,768.00	1.52
19	000001	平安银行	58,119	1,314,651.78	1.48
20	600309	万华化学	11,800	1,284,076.00	1.45
21	600031	三一重工	39,500	1,148,265.00	1.29
22	000568	泸州老窖	4,434	1,046,157.96	1.18
23	000002	万科A	43,000	1,023,830.00	1.15
24	601899	紫金矿业	105,452	1,021,829.88	1.15
25	000725	京东方A	158,400	988,416.00	1.11
26	601288	农业银行	318,500	965,055.00	1.09
27	601328	交通银行	194,195	951,555.50	1.07
28	603288	海天味业	7,358	948,814.10	1.07
29	600048	保利地产	75,300	906,612.00	1.02
30	600000	浦发银行	84,493	844,930.00	0.95
31	002304	洋河股份	4,054	839,988.80	0.95
32	601688	华泰证券	52,959	836,752.20	0.94
33	002714	牧原股份	13,720	834,450.40	0.94
34	601668	中国建筑	169,824	789,681.60	0.89
35	600585	海螺水泥	19,200	788,160.00	0.89
36	603501	韦尔股份	2,400	772,800.00	0.87
37	002142	宁波银行	19,830	772,775.10	0.87
38	600690	海尔智家	29,728	770,252.48	0.87
39	600809	山西汾酒	1,700	761,600.00	0.86



40	600016	民生银行	166,847	735,795.27	0.83
41	600837	海通证券	63,962	735,563.00	0.83
42	601601	中国太保	24,700	715,559.00	0.81
43	300122	智飞生物	3,600	672,228.00	0.76
44	002352	顺丰控股	9,801	663,527.70	0.75
45	600999	招商证券	33,552	638,159.04	0.72
46	601211	国泰君安	36,157	619,730.98	0.70
47	601766	中国中车	100,931	613,660.48	0.69
48	000063	中兴通讯	18,200	604,786.00	0.68
49	002027	分众传媒	61,561	579,289.01	0.65
50	601398	工商银行	105,276	544,276.92	0.61
51	600406	国电南瑞	23,280	541,027.20	0.61
52	601169	北京银行	104,600	509,402.00	0.57
53	601816	京沪高铁	96,100	508,369.00	0.57
54	600028	中国石化	115,067	501,692.12	0.56
55	601229	上海银行	60,626	497,133.20	0.56
56	601818	光大银行	129,951	491,214.78	0.55
57	600104	上汽集团	22,121	485,998.37	0.55
58	600019	宝钢股份	63,151	482,473.64	0.54
59	601988	中国银行	148,576	457,614.08	0.52
60	601628	中国人寿	13,415	454,634.35	0.51
61	601088	中国神华	20,644	402,970.88	0.45
62	000661	长春高新	1,000	387,000.00	0.44
63	300498	温氏股份	26,832	385,575.84	0.43
64	600009	上海机场	7,978	383,981.14	0.43
65	000538	云南白药	3,133	362,550.76	0.41
66	600346	恒力石化	13,100	343,744.00	0.39
67	601336	新华保险	7,375	338,586.25	0.38
68	601390	中国中铁	64,550	338,242.00	0.38
69	601658	邮储银行	64,200	322,284.00	0.36
70	601186	中国铁建	37,800	280,854.00	0.32
71	601006	大秦铁路	41,700	274,386.00	0.31
72	600050	中国联通	61,060	263,779.20	0.30
73	601989	中国重工	63,625	262,135.00	0.30
74	601857	中国石油	48,806	258,183.74	0.29
75	600015	华夏银行	37,564	232,521.16	0.26
76	000166	申万宏源	48,188	225,519.84	0.25
77	300015	爱尔眼科	3,060	217,198.80	0.24
78	000895	双汇发展	6,800	216,240.00	0.24
79	600745	闻泰科技	1,900	184,110.00	0.21
80	002736	国信证券	16,277	174,977.75	0.20
81	601138	工业富联	13,900	172,499.00	0.19
82	600018	上港集团	28,700	136,899.00	0.15
83	003816	中国广核	43,100	115,077.00	0.13

84	600438	通威股份	2,500	108,175.00	0.12
85	601998	中信银行	21,130	107,763.00	0.12
86	300433	蓝思科技	3,200	94,112.00	0.11
87	001979	招商蛇口	8,501	93,085.95	0.10
88	002607	中公教育	4,300	89,827.00	0.10
89	002493	荣盛石化	5,200	89,804.00	0.10
90	601633	长城汽车	2,000	87,180.00	0.10
91	688111	金山办公	200	78,960.00	0.09
92	600436	片仔癀	100	44,830.00	0.05
93	002938	鹏鼎控股	1,000	35,880.00	0.04
94	600588	用友网络	1,000	33,260.00	0.04
95	000876	新希望	1,000	14,670.00	0.02
96	600918	中泰证券	1,000	10,820.00	0.01
97	601995	中金公司	100	6,150.00	0.01
98	601360	三六零	500	6,105.00	0.01
99	601066	中信建投	100	3,143.00	0.00
100	601319	中国人保	100	593.00	0.00

## 7.3.2 期末积极投资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	688131	皓元医药	431	149,207.89	0.17
2	688700	东威科技	2,312	88,919.52	0.10
3	688621	阳光诺和	832	73,881.60	0.08
4	688161	威高骨科	603	63,948.15	0.07
5	688655	迅捷兴	3,083	62,893.20	0.07
6	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.07
7	688079	美迪凯	3,245	59,708.00	0.07
8	688662	富信科技	1,899	56,039.49	0.06
9	688319	欧林生物	1,974	53,969.16	0.06
10	688070	纵横股份	1,445	49,809.15	0.06
11	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.04
12	688633	星球石墨	649	36,259.63	0.04
13	688659	元琛科技	3,445	36,034.70	0.04
14	605090	九丰能源	1,090	35,326.90	0.04
15	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.04
16	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.04
17	001207	联科科技	682	22,581.02	0.03
18	688087	英科再生	839	18,424.44	0.02
19	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.02
20	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.02
21	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01

22	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.01
----	--------	------	-----	----------	------

#### 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	601816	京沪高铁	439,562.00	0.46
2	300122	智飞生物	264,757.00	0.28
3	000776	广发证券	236,884.00	0.25
4	000166	申万宏源	182,978.00	0.19
5	300059	东方财富	180,480.00	0.19
6	603501	韦尔股份	177,828.00	0.19
7	601658	邮储银行	175,700.00	0.18
8	600276	恒瑞医药	129,795.00	0.14
9	002027	分众传媒	90,972.00	0.10
10	002736	国信证券	90,480.00	0.09
11	000063	中兴通讯	89,910.00	0.09
12	600030	中信证券	89,760.00	0.09
13	600438	通威股份	89,350.00	0.09
14	601633	长城汽车	89,239.00	0.09
15	300433	蓝思科技	88,942.00	0.09
16	601601	中国太保	88,852.00	0.09
17	002475	立讯精密	88,804.00	0.09
18	002493	荣盛石化	88,660.00	0.09
19	600745	闻泰科技	85,725.00	0.09
20	688111	金山办公	84,198.00	0.09

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	000333	美的集团	617,040.00	0.65
2	300059	东方财富	549,489.00	0.58
3	000651	格力电器	449,626.00	0.47
4	601225	陕西煤业	403,633.44	0.42
5	600887	伊利股份	302,255.00	0.32
6	000776	广发证券	299,510.00	0.31
7	601318	中国平安	296,251.00	0.31

8	000002	万 科 A	273,540.00	0.29
9	000725	京东方 A	273,258.00	0.29
10	600036	招商银行	273,092.00	0.29
11	600346	恒力石化	259,787.00	0.27
12	600519	贵州茅台	245,501.00	0.26
13	000568	泸州老窖	232,709.00	0.24
14	000001	平安银行	229,240.00	0.24
15	002475	立讯精密	193,478.00	0.20
16	601288	农业银行	189,333.00	0.20
17	601088	中国神华	180,619.00	0.19
18	688165	埃夫特	177,250.80	0.19
19	002415	海康威视	167,102.00	0.18
20	000538	云南白药	151,251.00	0.16

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

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,970,106.06
卖出股票收入（成交）总额	11,440,977.96

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

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的兴业银行（601166），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。

报告期内本基金投资的招商银行（600036），因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品、理财产品之间风险隔离不到位等多项违规行为，于 2021 年 05 月 17 日被中国银行保险监督管理委员会处以罚款 7170 万元。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金系指数型基金，对上述证券的投资均系被动按照指数成分股进行复制。

其余八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	6,014.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	472.86
5	应收申购款	18,637.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,124.27

#### 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

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	688700	东威科技	88,919.52	0.10	新股锁定流 通受限

## §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
海富通中证 100	4,181	13,052.44	1,917,889.92	3.51%	52,654,373.36	96.49%

指数 A						
海富通中证 100 指数 C	4	4,715.31	-	-	18,861.25	100.00 %
合计	4,185	13,044.47	1,917,889.92	3.51%	52,673,234.61	96.49%

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

### 海富通中证100指数A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	齐齐哈尔中通公共交通有限责任公司	500,030.00	26.96%
2	何小娥	384,511.00	20.74%
3	单世扬	100,003.00	5.39%
4	葛光亚	92,007.00	4.96%
5	许海龙	66,208.00	3.57%
6	北京鸿愿非凡装饰材料有限公司	60,000.00	3.24%
7	周伟国	54,212.00	2.92%
8	杨凯	52,400.00	2.83%
9	滕王峰	50,400.00	2.72%
10	李瑶琼	50,001.00	2.70%

注：持有人为场内持有人。

## 8.3 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	海富通中证 100 指数 A	145,461.83	0.2665%
	海富通中证 100 指数 C	198.16	1.0506%
	合计	145,659.99	0.2668%

## 8.4 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	海富通中证 100 指数 A	10~50
	海富通中证 100 指数 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通中证 100 指数 A	0
	海富通中证 100 指数 C	0

	合计	0
--	----	---

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通中证 100 指数 A	海富通中证 100 指数 C
基金合同生效日(2009 年 10 月 30 日)基金份额总额	2,087,148,875.30	-
本报告期期初基金份额总额	58,924,471.18	198.16
本报告期基金总申购份额	8,195,467.29	18,669.44
减:本报告期基金总赎回份额	12,547,675.19	6.35
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	54,572,263.28	18,861.25

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	
国盛证券	2	4,218,741.18	29.35%	3,085.09	33.63%	-



华创证券	1	4,076,278.92	28.36%	1,676.55	18.27%	-
华西证券	1	2,628,959.87	18.29%	1,922.59	20.96%	-
海通证券	2	1,761,030.19	12.25%	1,287.81	14.04%	-
开源证券	2	1,654,372.20	11.51%	1,176.74	12.83%	-
野村东方国际 证券	1	35,502.60	0.25%	25.25	0.28%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内基金租用券商交易单元未发生变化。

## 2、(1)交易单元的选择标准

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

## (2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

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

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

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例

国盛证券	87,193.00	20.19%	-	-	-	-
华创证券	155,044.04	35.91%	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	189,525.60	43.90%	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际 证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

## 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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-01
2	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加中国银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-01
3	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加平安银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-05
4	海富通基金管理有限公司关于旗下基金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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-12
5	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加中国农业银行股份有限公司申购及定期定额	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金	2021-01-19

	投资费率优惠活动的公告	电子披露网站	
6	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加浙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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-30
7	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华龙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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-24
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	上海证券报、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部分基金新增东吴证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-05
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	上海证券报、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	上海证券报、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	上海证券报、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	上海证券报、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部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号—指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30
15	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-06
16	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-20
17	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加中国人寿保险股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-30

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 99 只公募基金。截至 2021 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1296 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2011 年 12 月，海富通全资子公司——海富通资产管理（香港）有限公司获得证监会核准批复 RQFII（人民币合格境外机构投资者）业务资格，能够在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2019 年 3 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金再度被权威媒体《证券时报》授予第十四届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金和 2018 年度绝对收益明星基金。2019 年 4 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金被权威财经媒体《中国证券报》和《上海证券报》分别评选为第十六届中国基金业金牛奖——三年期开放式混合型持续优胜金牛基金和第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·灵活配置型基金奖（三年期）。同时，海富通基金管理有限公司荣获《上海证券报》第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·成长基金管理公司奖。

2020 年 3 月，由《中国证券报》主办的第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金牛进取奖”，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖项。2020 年 7 月，由《上海证券报》主办的第十七届金基金奖名单揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金基金·股票投资回报基金管理公司奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准设立海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）的文件
- （二）海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）基金合同
- （三）海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）招募说明书
- （四）海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）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）报告期内海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）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