

海富通安颐收益混合型证券投资基金
2021 年第 3 季度报告
2021 年 9 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年十月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 海富通安颐收益混合 |
| 基金主代码 | 519050 |
| 交易代码 | 519050 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013 年 5 月 29 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 479,089,569.74 份 |
| 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，积极把握股票市场的投资机会，确保资产的保值增值，实现战胜绝对收益基准的目标，为投资者提供稳健的养老理财工具。 |
| 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，在实现既定的投资目标同时将可能的损失最小化。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。 |
| 业绩比较基准 | 三年期银行定期存款利率(税后)+2% |

| | | |
|-----------------|--|------------------|
| 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。 | |
| 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 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 海富通安颐收益混合 A | 海富通安颐收益混合 C |
| 下属两级基金的交易代码 | 519050 | 002339 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 346,945,782.18 份 | 132,143,787.56 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 (2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日) | |
|----------------|---|----------------|
| | 海富通安颐收益混合 A | 海富通安颐收益混合 C |
| 1.本期已实现收益 | 12,651,710.77 | 5,577,640.23 |
| 2.本期利润 | 2,640,359.12 | 1,248,122.87 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0070 | 0.0075 |
| 4.期末基金资产净值 | 557,876,927.16 | 215,996,679.10 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.608 | 1.635 |

注：（1）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。

（2）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。

（3）海富通安颐收益混合型证券投资基金（原海富通养老收益混合型证券投资基金）于2016年1月6日刊登公告，自2016年1月8日起增加收取销售服务费的C类份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1、海富通安颐收益混合 A：

| 阶段 | 净值增长率① | 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 |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.50% | 0.27% | 1.18% | 0.01% | -0.68% | 0.26% |
| 过去六个月 | 2.10% | 0.24% | 2.35% | 0.01% | -0.25% | 0.23% |
| 过去一年 | 6.77% | 0.27% | 4.75% | 0.01% | 2.02% | 0.26% |
| 过去三年 | 30.63% | 0.29% | 14.95% | 0.01% | 15.68% | 0.28% |
| 过去五年 | 44.32% | 0.26% | 26.13% | 0.01% | 18.19% | 0.25% |
| 自基金合同生效起至今 | 98.73% | 0.39% | 51.54% | 0.02% | 47.19% | 0.37% |

2、海富通安颐收益混合 C:

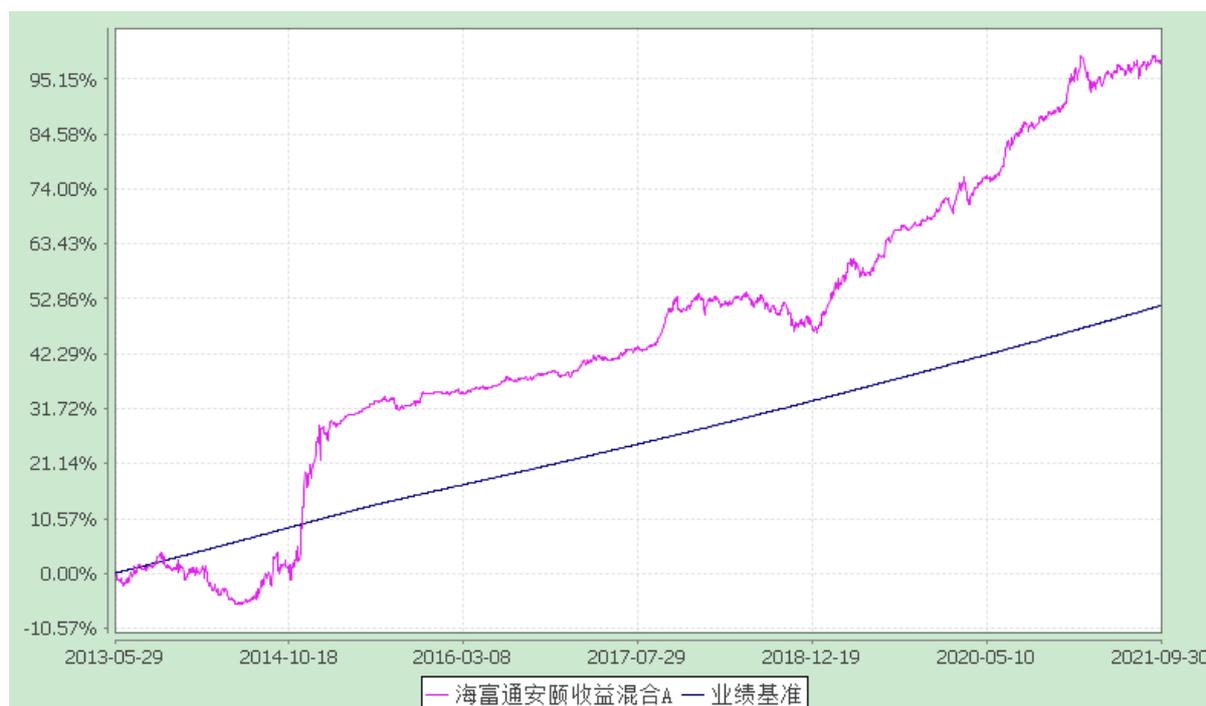
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.49% | 0.27% | 1.18% | 0.01% | -0.69% | 0.26% |
| 过去六个月 | 2.06% | 0.23% | 2.35% | 0.01% | -0.29% | 0.22% |
| 过去一年 | 6.65% | 0.26% | 4.75% | 0.01% | 1.90% | 0.25% |
| 过去三年 | 31.85% | 0.29% | 14.95% | 0.01% | 16.90% | 0.28% |
| 过去五年 | 45.80% | 0.26% | 26.13% | 0.01% | 19.67% | 0.25% |
| 自基金合同生效起至今 | 50.57% | 0.25% | 30.49% | 0.01% | 20.08% | 0.24% |

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

海富通安颐收益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的历史走势对比图

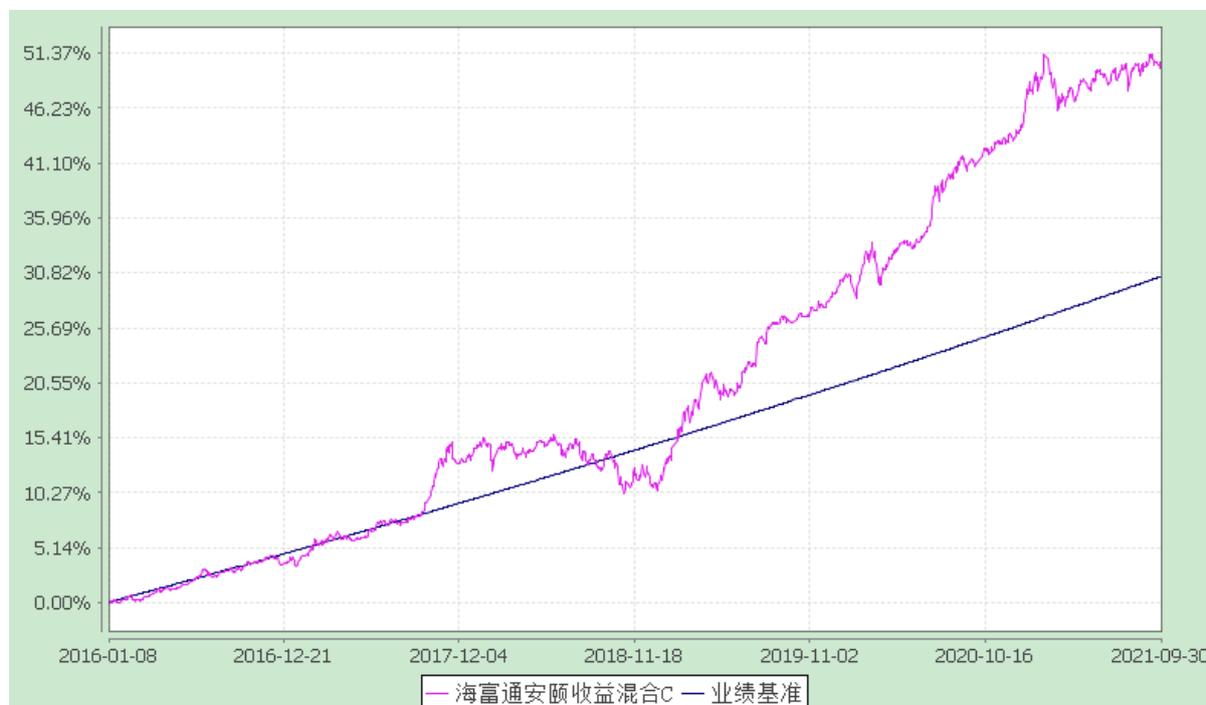
1. 海富通安颐收益混合 A

(2013 年 5 月 29 日至 2021 年 9 月 30 日)



2. 海富通安颐收益混合 C

(2016 年 1 月 8 日至 2021 年 9 月 30 日)



注：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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|--------------------------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 杜晓海 | 本基金的基金经理；公司总经理助理兼量化投资部总监 | 2016-06-22 | - | 21 年 | 硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research 金融工程师，American Bourses Corporation 中国区总经理，海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监，现任海富通基金管理有限公司总经理助理兼量化投资部总监。2016 年 6 月起任海富通安颐收益混合（原海富通养老收益混合）基金经理。2016 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣荣混合基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 10 月兼任海富通富睿混合（现海富通沪深 300 增强）基金经理。2018 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强的基金经理。2018 |

| | | | | | |
|-----|----------|------------|---|--|---|
| | | | | <p>年 4 月至 2020 年 10 月兼任海富通量化先锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合的基金经理。2018 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月起兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020 年 3 月至 2021 年 7 月任海富通中证 500 增强（原海富通中证内地低碳指数）基金经理。2020 年 4 月至 2021 年 7 月任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年 5 月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通富利三个月持有基金经理。</p> | |
| 夏妍妍 | 本基金的基金经理 | 2019-05-22 | - | 7 年 | <p>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、海富通富祥混合的基金经理。2019 年 10 月至 2021 年 9 月任海富通瑞合纯债基金经理。2019 年 10 月至 2020 年 11 月任海富通瑞</p> |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 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。2021 年 8 月起兼任海富通瑞兴 3 个月定开债券基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

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

2、证券从业年限的计算标准为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

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（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年三季度，国内经济下行趋势明显，尤其是消费以及房地产投资。消费受制于经济下行，收入预期放缓以及疫情反复影响下，消费同比增速持续下滑。房地产投资受较为严苛的信贷政策以及房企“三条红线”的影响，也快速下滑。价格指数方面，CPI

表现平稳，但 PPI 持续上行超预期。在“碳中和”、“碳达峰”以及“双限”的背景下，能源板块供需错配情况较为严重，价格上涨凶猛。海外经济方面，美国第三季度受 Delta 病毒主导的新一轮疫情冲击，经济活动再次疲弱。货币政策方面，市场对于美联储在 11 月议息会议后宣布开启逐步缩减购债规模有较强的共识。

三季度国内权益市场小幅下跌，周期、消费表现分化显著。A 股主要指数方面，上证指数下跌 0.64%，沪深 300 下跌 6.85%，中证 800 下跌 4.36%，中小 100 指下跌 4.98%，创业板指下跌 6.69%，中证 500 上涨 4.34%。分行业看，周期板块显著上涨，其中涨幅前五的行业为煤炭、有色金属、钢铁、电力及公用事业、基础化工，全部为周期行业，分别上涨 40.87%、26.63%、22.46%、20.25%和 17.83%。消费板块显著回调，跌幅前五的行业为消费者服务、医药、食品饮料、家电、纺织服装，分别下跌 17.89%、14.67%、12.91%、10.24%和 9.91%。从三季度 A 股内部的结构看，消费板块表现弱势和国内消费数据快速下滑相符，而周期板块大幅上涨和不断上行超预期的 PPI 数据相吻合。

市场结构方面，三季度市场结构延续了上半年的情况，周期和成长交相呼应成为市场两条主线，消费表现弱势。但分化裂口在三季度继续加速和扩大。业绩增速高且未来确定性强的新能源汽车产业链引领整个成长板块的行情，也从需求端带动了部分周期品的上涨。消费领域除了医药 CXO 和次高端白酒，整体表现较弱。季末在裂口极大的情况下分化有所收敛，部分消费品和“核心资产”有触底反弹的趋势，而周期和成长则开始回调。

本报告期,本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。

展望 4 季度，本基金的投资思路将在控制风险的基础上，积极地捕捉市场的结构性机会，力争跑赢市场。同时，本基金依然会积极参与新股申购，努力增厚收益。本基金也将利用动态的仓位调整或者股指期货套保等风险管理工具来控制回撤风险。

固定收益方面，回顾三季度，经济基本面总体表现为增速有所放缓，债券收益率震荡下行，收益率曲线趋于平坦化。国内经济方面，PMI 指标连续数月下滑，9 月底已降至 50% 以下，工业生产受到上游原材料价格上涨以及能耗双控政策的严格执行导致 9 月以来全国各省限电限产活动明显增多的影响，增速明显回落。房地产投资在集中供地与更加严格的政策环境下，受到销售增速快速走弱的影响明显下滑，出现一定的失速风险。消费方面同样表现较弱，主要受到国内新冠疫情在多地反复、居民收入未得到有效改善的影响。出口方面受到海外经济复苏的支撑维持较好的韧性，尤其是机电产品出口表现尤其亮眼。通胀方面表现分化，CPI 受到食品价格的拖累同比增速持续下滑，8 月同比上涨 0.8%。PPI 受到煤炭、原油等上游原材料价格上涨的影响，同比增速在 8 月飙升至 9.5%。货币政策方面央行维稳态度明显，7 月降准释放中长期流动约 1 万亿元，9 月 MLF 等量续作，跨季重启 14 天逆回购投放均保持流动性的平稳宽松。信用环境方面社融增速有望阶段见底，地产与城投平台融资行为受到严监管政策的影响。对应到债市而言，3 季度前半段受到降准与流动性宽松的影响，利率债收益率普遍下行，10 年期国

债到期收益率一度下探至 2.8% 的位置。但 8 月以来经济明显走弱，宽信用预期逐渐升温，债市又一度回调至 2.9% 的位置。整季来看，3 季度十年期国债收益率累计下行 20bp，十年期国开债收益率累计下行 29bp。

对于信用债而言，回顾三季度，信用债收益率先降后升，短融、中票收益率回升至历史 20%、15% 分位数附近。城投方面，7 月初市场流传一份“15 号文”，市场情绪较为恐慌；随后补充通知在执行层面释放了一定的操作空间，但本质上仍是强监管精神的延续。地产方面，调控政策再度加码，叠加民企地产的信用风险不断释放，房地产行业景气度快速下行，成为经济基本面最大的风险源。此外，监管针对存续和新发的以摊余成本计量的理财产品做出规定。若严格执行，理财产品净值可能出现波动，银行永续债和二级资本债的投资价值会有所弱化；但同时机构欠配压力较大，市场处于动态博弈中。

可转债方面，三季度中证转债指数上涨 6.39%，行业轮动较快，转债中受双控政策影响的周期、电力、新能源及运营类相关个券获得较大涨幅。

三季度，本基金债券部分以精选中高等级信用债配置策略为主，并以适度仓位参与利率债波段交易增厚收益。整体来看，规避了信用风险，获得了稳定较高收益。

四季度，本基金债券部分将在严格控制信用风险的前提下，精选个券，争取获得较高静态收益，并视市场行情，适度关注利率债的交易机会。从信用债品种上来说，关注近期收益率快速上升、信用利差更趋合理的银行二级资本债的配置机会。同时，配合股票部分投资策略，做好流动性管理。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通安颐收益混合 A 净值增长率为 0.50%，同期业绩比较基准收益率为 1.18%，基金净值跑输业绩比较基准 0.68 个百分点。海富通安颐收益混合 C 净值增长率为 0.49%，同期业绩比较基准收益率为 1.18%，基金净值跑输业绩比较基准 0.69 个百分点。报告期内股票市场波动较大，导致基金跑输基准。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 177,630,818.28 | 22.85 |
| | 其中：股票 | 177,630,818.28 | 22.85 |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 2 | 固定收益投资 | 561,489,969.10 | 72.23 |
| | 其中：债券 | 561,489,969.10 | 72.23 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 14,000,000.00 | 1.80 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 13,320,297.05 | 1.71 |
| 7 | 其他资产 | 10,961,856.93 | 1.41 |
| 8 | 合计 | 777,402,941.36 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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 | 211,359.72 | 0.03 |
| B | 采矿业 | 5,735,096.20 | 0.74 |
| C | 制造业 | 119,039,671.24 | 15.38 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 10,969,065.00 | 1.42 |
| E | 建筑业 | 193,922.00 | 0.03 |
| F | 批发和零售业 | 1,171,251.26 | 0.15 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,005,997.34 | 0.13 |
| H | 住宿和餐饮业 | 3,345.12 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 5,460,638.57 | 0.71 |
| J | 金融业 | 26,827,126.78 | 3.47 |
| K | 房地产业 | 1,472,469.50 | 0.19 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,582,752.00 | 0.20 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 2,112,195.76 | 0.27 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 168,129.17 | 0.02 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------|----------------|-------|
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 367,851.40 | 0.05 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,309,947.22 | 0.17 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 177,630,818.28 | 22.95 |

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 132,114 | 6,665,151.30 | 0.86 |
| 2 | 601012 | 隆基股份 | 77,140 | 6,362,507.20 | 0.82 |
| 3 | 000858 | 五粮液 | 23,322 | 5,116,613.58 | 0.66 |
| 4 | 000568 | 泸州老窖 | 19,500 | 4,320,810.00 | 0.56 |
| 5 | 600519 | 贵州茅台 | 2,314 | 4,234,620.00 | 0.55 |
| 6 | 600887 | 伊利股份 | 108,600 | 4,094,220.00 | 0.53 |
| 7 | 600309 | 万华化学 | 37,200 | 3,971,100.00 | 0.51 |
| 8 | 600900 | 长江电力 | 176,900 | 3,891,800.00 | 0.50 |
| 9 | 600406 | 国电南瑞 | 106,920 | 3,839,497.20 | 0.50 |
| 10 | 000001 | 平安银行 | 212,000 | 3,801,160.00 | 0.49 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 87,631,484.50 | 11.32 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 142,976,471.90 | 18.48 |
| | 其中：政策性金融债 | 71,602,471.90 | 9.25 |
| 4 | 企业债券 | 78,639,000.00 | 10.16 |
| 5 | 企业短期融资券 | 10,023,000.00 | 1.30 |
| 6 | 中期票据 | 211,878,000.00 | 27.38 |
| 7 | 可转债(可交换债) | 975,012.70 | 0.13 |
| 8 | 同业存单 | 29,367,000.00 | 3.79 |

| | | | |
|----|----|----------------|-------|
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 561,489,969.10 | 72.56 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 200212 | 20 国开 12 | 500,000 | 50,685,000.00 | 6.55 |
| 2 | 019645 | 20 国债 15 | 352,050 | 35,236,684.50 | 4.55 |
| 3 | 101800823 | 18 广州地铁 MTN004 | 300,000 | 30,114,000.00 | 3.89 |
| 4 | 112115066 | 21 民生银行 CD066 | 300,000 | 29,367,000.00 | 3.79 |
| 5 | 1821004 | 18 广州农商二级 01 | 200,000 | 20,534,000.00 | 2.65 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量 | 合约市值（元） | 公允价值变动（元） | 风险说明 |
|---------------|--------|--------|---------------|-------------|-------------|
| IH2112 | IH2112 | -10.00 | -9,589,200.00 | -420,313.04 | - |
| IF2112 | IF2112 | -5.00 | -7,256,100.00 | -130,320.00 | - |
| IC2112 | IC2112 | 5.00 | 6,963,000.00 | 174,200.00 | - |
| 公允价值变动总额合计(元) | | | | | -376,433.04 |
| 股指期货投资本期收益(元) | | | | | 295,693.04 |

| | |
|-------------------|-------------|
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) | -376,433.04 |
|-------------------|-------------|

注：股指期货投资本期收益中已扣除本期股指期货差价收入应缴纳增值税额。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的股指期货投资以套期保值为主要目的，并选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或者空头套期保值，符合既定投资政策及投资目标。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的20国开12（200212）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、设置不合理存款考核要求，以贷转存，虚增存款、贷款风险分类不准确等违规行为，于2020年12月25日被中国银行保险监督管理委员会处罚罚款4880万元。

对该证券的投资决策程序的说明：银行业整体信用水平高，且该银行为全国大型政策性银行，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21民生银行CD066(112115066)的发行人，作为银行间债券市场做市商，在开展做市业务时主导开展倒量等虚假交易；作为债务融资工具存续期管理机构，未及时召开“18年浦建设MTN001”持有人会议，持有人会议组织召开不符合规定程序，于2021年7月5日被中国银行间市场交易商协会予以通报批评，并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。因监管发现问题屡查屡犯、检查发现问题整改不到位、对责任人员的责任认定和问责不到位、内部制度管理不足、配合现场检查不力、信息系统管控有效性不足、未向监管部门真实反映业务数据等违规行为，于2021年7月13日被中国银行保险监督管理委员会处罚罚款11450万元。

对该证券的投资决策程序的说明：银行业整体信用水平高，且该银行为全国大型银行，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。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 2,067,356.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 8,467,318.93 |
| 5 | 应收申购款 | 427,182.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 10,961,856.93 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|------------|--------------|
| 1 | 132015 | 18 中油 EB | 366,835.00 | 0.05 |
| 2 | 113011 | 光大转债 | 203,827.30 | 0.03 |
| 3 | 110047 | 山鹰转债 | 177,285.00 | 0.02 |
| 4 | 110061 | 川投转债 | 99,107.00 | 0.01 |
| 5 | 110051 | 中天转债 | 50,903.40 | 0.01 |
| 6 | 132011 | 17 浙报 EB | 50,750.00 | 0.01 |
| 7 | 132008 | 17 山高 EB | 26,305.00 | 0.00 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 海富通安颐收益混合 A | 海富通安颐收益混合 C |
|---------------|----------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 426,162,828.41 | 209,338,664.75 |
| 本报告期基金总申购份额 | 18,829,212.70 | 17,960,052.59 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 98,046,258.93 | 95,154,929.78 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 346,945,782.18 | 132,143,787.56 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 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 104 只公募基金。截至 2021 年 9 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模超 1380 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

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”。

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。2021 年 9 月，由《中国证券报》主办的第十八届“中国基金业金牛奖”揭晓，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。

9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

（一）中国证监会批准设立海富通安颐收益混合型证券投资基金（原海富通养老收益混合型证券投资基金）的文件

（二）海富通安颐收益混合型证券投资基金（原海富通养老收益混合型证券投资基金）基金合同

(三) 海富通安颐收益混合型证券投资基金(原海富通养老收益混合型证券投资基金) 招募说明书

(四) 海富通安颐收益混合型证券投资基金(原海富通养老收益混合型证券投资基金) 托管协议

(五) 中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件

(六) 法律法规及中国证监会规定的其他文件

9.2 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。

9.3 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
二〇二一年十月二十七日