

**海富通强化回报混合型证券投资基金**  
**2021 年第 4 季度报告**  
**2021 年 12 月 31 日**

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年一月二十二日

## §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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 21 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	海富通强化回报混合
基金主代码	519007
交易代码	519007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 5 月 25 日
报告期末基金份额总额	277,563,843.21 份
投资目标	每年超越三年期定期存款（税前）加权平均收益率。
投资策略	本基金认为，灵活而有纪律的资产配置策略和精选证券是获得回报的主要来源，而收益管理和风险管理是保证回报的重要手段。因此，本基金将运用资产配置、精选证券和收益管理三个层次的投资策略，实现基金的投资目标。
业绩比较基准	三年期银行定期存款(税前)加权平均收益率
风险收益特征	追求每年高于一定正回报的投资品种。属于适度风险、适中收益的混合型基金，其长期的预期收益和风险高于债券基金，低于股票基金。
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

### §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 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	-1,251,195.17
2.本期利润	3,953,488.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.0140
4.期末基金资产净值	276,316,948.10
5.期末基金份额净值	0.9955

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。

#### 3.2 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

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	1.48%	0.28%	0.69%	0.01%	0.79%	0.27%
过去六个月	2.52%	0.34%	1.38%	0.01%	1.14%	0.33%
过去一年	7.97%	0.44%	2.75%	0.01%	5.22%	0.43%
过去三年	41.81%	0.50%	8.49%	0.01%	33.32%	0.49%
过去五年	23.97%	0.56%	14.54%	0.01%	9.43%	0.55%
自基金合同生效起至今	180.61%	1.21%	73.76%	0.01%	106.85%	1.20%

##### 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

海富通强化回报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

(2006 年 5 月 25 日至 2021 年 12 月 31 日)



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十二条（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		
陶敏	本基金的基金经理	2018-04-18	-	15 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2004 年 7 月至 2008 年 8 月任华泰柏瑞基金管理有限公司基金清算与注册登记经理，2010 年 7 月至 2015 年 7 月任光大保德信基金管理有限公司行业研究员和策略研究员。2015 年 7 月加入海富通基金管理有限公司，历

					任权益投资部行业研究员、周期组组长、基金经理助理。2018 年 4 月起任海富通强化回报混合的基金经理。
方昆明	本基金的基金经理	2021-10-29	-	11 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任浙商银行投资经理、民生银行投资高级经理、渤海银行上海分行金融市场一部总经理助理、营口银行上海金融中心债券投资交易主管、北京肯特瑞基金销售有限公司产品管理和投资总监、上海富诚海富通资产管理有限公司投资管理部总经理。2021 年 9 月加入海富通基金管理有限公司。2021 年 10 月起任海富通强化回报混合基金经理。
谈云飞	本基金的基金经理	2017-02-09	2021-10-20	16 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 4 月至 2014 年 6 月就职于华宝兴业基金管理有限公司，曾任产品经理、研究员、专户投资经理、基金经理助理，2014 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2014 年 7 月至 2015 年 10 月任海富通现金管理货币基金经理。2014 年 9 月至 2020 年 9 月任海富通季季增利理财债券基金经理。2015 年 1 月起兼任海富通稳健添利债券基金经理。2015 年 4 月至 2020 年 1 月兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年 2 月起兼任海富通货币基金经理。2016 年 4 月至 2017

				<p>年 6 月兼任海富通纯债债券、海富通双福债券（原海富通双福分级债券）、海富通双利债券基金经理。2016 年 4 月至 2020 年 1 月兼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 9 月起兼任海富通聚利债券基金经理。2016 年 9 月至 2020 年 1 月兼任海富通欣荣混合基金经理。2016 年 9 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合基金经理。2017 年 2 月至 2021 年 10 月兼任海富通强化回报混合基金经理。2017 年 3 月起兼任海富通欣享混合基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 7 月至 2020 年 9 月任海富通季季通利理财债券基金经理。2019 年 9 月起兼任海富通中短债债券基金经理。2021 年 2 月起兼任海富通惠睿精选混合基金经理。</p>
--	--	--	--	--

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 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 年四季度，国内经济延续下行趋势，其中房地产投资、销售、新开工全线下滑，基建投资与消费继续疲软，出口及制造业投资链条仍是少数亮点。价格指数方面，CPI 走势相对温和，PPI 在创出历史新高后开始回落。在需求下滑及政策“保供顺价”背景下，能源领域的供需错配暂时告一段落。海外经济方面，美国商品消费向服务消费切换的速度慢于预期。商品消费仍然高于趋势水平，服务需求仍低于趋势水平。货币政策方面，美联储加速缩减购债规模，同时加息预期开始升温。

四季度国内权益市场延续上行，科技成长板块表现较好，消费板块延续分化，周期板块显著调整。A 股主要指数方面，上证指数上涨 2.01%，沪深 300 上涨 1.52%，中证 800 上涨 2.01%，中小 100 指上涨 6.21%，创业板指上涨 2.40%，中证 500 上涨 3.60%。以中信行业分类看，成长板块显著上涨，四季度涨幅前五的行业为传媒、国防军工、通信、综合金融、轻工制造，分别上涨 22.72%、17.48%、14.59%、12.58% 和 12.21%，其中大部分为成长性板块；周期板块显著回调，跌幅前五的行业为煤炭、石油石化、钢铁、消费者服务、银行，分别下跌 12.61%、9.51%、7.17%、6.4% 和 0.94%。从四季度 A 股内部结构看，成长板块表现较好，与流动性充裕下的中小盘风格发散有关；消费板块表现分化，一方面与国内消费数据疲弱相符，另一方面则与部分消费品提价有关；而周期板块大幅调整，则与政策“保供顺价”密切相关。

市场结构方面，四季度市场结构延续了前三季度情况，在资金存量博弈行情下，行业、风格轮动较快，周期、成长交相成为市场主线，消费阶段性有所表现。业绩增速高且确定性强的新能源汽车产业链引领整个成长板块。消费领域受部分产品提价及提价预期影响有所表现。在板块裂口短期过大情况下，风格分化在四季度陆续有所收敛，部分消费品和“核心资产”触底反弹，而周期和成长则开始回调。

2021 年 4 季度，本基金取得 1.48 个百分点的正收益和 0.79 个百分点的超额收益，虽然总体表现较 3 季度有所改善，但距离内心的期望仍然有差距。未能在年末实现收盘净值新高，至为遗憾！造成这一情况的客观原因在于市场环境，进入四季度之后市场上缺乏可预见的持续性强的收益增长板块。2021 年以来市场主线风格上开始变幻不定：春节之后的暴跌宣告了“茅指数”的休息；三月份之后半导体、CXO、创新药所代表的成长股反弹到了年中也开始盘整；持续性最好的光伏风电和“宁王”在四季度也陆续“掉电”，代之而起的是“低估值”的“绿色”火电和“元宇宙”主题投资；而且代表存量经济的周期股也受到 PPI 见顶的预期拖累全面回调，金融地产则受到爆雷的头部上市房企冲击。而主观上的原因则在于前置了稳增长预期：始于 2018 年的宏观调控政策在 2021 年给房地产行业的资产负债表带来了巨大的压力，并影响到下半年的土地市场，这意味着抵押品的估值乃至财政都有潜在的隐忧。基于上述认识，四季度本基金逐步将净增加的权益头寸结构向金融地产链条倾斜，而市场却仍然在成长股的旋律中徘徊。

展望 2022 年中期，结合 2021 年底的中央经济工作会议的政策基调和市场内外环境，围绕稳定存量经济的布局极大概率上来看会成为行情的主线。基于这条主线的布局是在 2021 年三季报里就提及到的金融地产产业链。历史经验告诉我们，一旦中国的政策主线在于存量经济的稳定增长，那么油气等大宗品的需求都不会太差，同时流动性会因为实体信用扩张而显得不那么宽裕，所以本基金会继续三季报里提及的油气链条的布局。同时，为了控制组合波动性，还会在全市场自下而上筛选布局一批预收账款增速高、净现金率高、分红率高的财务指标优异的公司。

固定收益方面，四季度国内经济有所走弱，债券收益率呈现震荡小幅下行。具体而言，10 月以来限电、能耗双控等不利因素消退，国内生产有所反弹，PMI 指标重新回到 50% 以上。但投资方面受到“贷款双集中”、“三道红线”监管、集中供地等政策的影响，同时以恒大为代表的风险事件在地产行业发酵蔓延，地产投资增速大幅回落，单月同比增速转负；同时基建投资增速在缺乏项目与年内缺乏托底经济的动力的情况下维持低位；制造业投资在中游出口需求较好、高技术产业投资旺盛的带动下表现强势。四季度消费在国内疫情局部反复的情况下表现较为疲软，尤其是线下消费与餐饮相关的行业受损严重。出口受到海外经济复苏的支撑维持较好的韧性，其中机电产品出口表现亮眼。通胀方面，四季度 CPI 在猪肉价格企稳、蔬菜价格受极端天气影响的背景下有所上行，PPI 在煤炭保供限价的政策组合下见顶回落。在这种经济环境下，四季度货币政策继续维持宽松，12 月央行年度第 2 次降准 50bp，释放中长期资金约 1.2 万亿，此外还陆续推出碳减排支持工具、下调支农支小再贷款利率等结构性政策。

对应债市而言，10 月宽货币落空而宽信用预期升温，债券到期收益率上行，最高达到 3.04% 的水平。11 月新冠变异毒株欧米克戎对资本市场的影响开始发酵，债券到期收益率震荡下行。12 月随着经济基本面走弱被进一步确认，在降准的带下降息预期逐渐升温，10 年期国债到期收益率年底下行至 2.79% 的水平。整个四季度 10 年期国债收益率下行 10.2BP。

信用债方面，四季度信用债收益率总体波动下行。当前信用债收益率整体处于历史



1/5 分位数以下，信用利差继续分化。城投方面，广东、上海于 10 月先后宣布启动全域无隐性债务试点，同时，土地市场热度下降，引发市场对地方财政收入下滑、可协调资源减少以及城投偿债能力弱化的担忧，城投偿债政策整体呈现“管两头”的特征；地产方面，下半年房地产融资、拿地、销售受到全面管控，信用风险事件和异常成交频发，行业利差大幅攀升，虽 11 月以来针对地产的政策导向缓和，但改善的背后行业内部分化加剧。

可转债方面，4 季度中证转债指数上涨 7.0%，转债表现依旧亮眼。转债受到市场资金热捧，整体估值水平也处于历史高位。

本基金债券部分在报告期内维持部分中等期限信用债的配置，并提高利率债的波段操作仓位，债券部分收益较为稳定。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 1.48%，同期业绩比较基准收益率为 0.69%，基金净值跑赢业绩比较基准 0.79 个百分点。

#### 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	110,216,954.43	39.53
	其中：股票	110,216,954.43	39.53
2	固定收益投资	113,324,732.97	40.64
	其中：债券	113,324,732.97	40.64
	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	41,528,149.89	14.89
	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	11,049,777.85	3.96

7	其他资产	2,733,941.74	0.98
8	合计	278,853,556.88	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	-	-
B	采矿业	10,143,625.48	3.67
C	制造业	43,828,597.39	15.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	543,605.00	0.20
E	建筑业	2,615,595.00	0.95
F	批发和零售业	5,738,193.00	2.08
G	交通运输、仓储和邮政业	3,267,585.00	1.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,678,186.43	2.42
J	金融业	28,528,357.08	10.32
K	房地产业	7,741,641.05	2.80
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	1,131,569.00	0.41
S	综合	-	-
	合计	110,216,954.43	39.89

### 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	002946	新乳业	315,800	5,033,852.00	1.82
2	002142	宁波银行	128,136	4,905,046.08	1.78
3	600926	杭州银行	341,700	4,380,594.00	1.59
4	601318	中国平安	82,300	4,148,743.00	1.50
5	600566	济川药业	145,600	4,126,304.00	1.49
6	002353	杰瑞股份	94,440	3,777,600.00	1.37
7	600729	重庆百货	144,900	3,770,298.00	1.36
8	002262	恩华药业	190,800	2,986,020.00	1.08
9	601360	三六零	227,100	2,888,712.00	1.05
10	601628	中国人寿	92,300	2,777,307.00	1.01

### 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	4,992,500.00	1.81
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,202,000.00	7.31
	其中：政策性金融债	20,202,000.00	7.31
4	企业债券	37,011,500.00	13.39
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	30,533,000.00	11.05
7	可转债（可交换债）	20,585,732.97	7.45
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	113,324,732.97	41.01

### 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	136499	16 洪市政	110,000	11,093,500.00	4.01
2	101901649	19 陕煤化 MTN007	100,000	10,247,000.00	3.71
3	210203	21 国开 03	100,000	10,211,000.00	3.70
4	102100723	21 新世界 MTN001	100,000	10,205,000.00	3.69
5	175754	21 浦房 01	100,000	10,153,000.00	3.67

## 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

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 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。

## 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，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	88,389.08
2	应收证券清算款	823,328.24
3	应收股利	-
4	应收利息	1,821,131.84
5	应收申购款	1,092.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,733,941.74

### 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	127012	招路转债	1,515,805.20	0.55
2	110059	浦发转债	1,446,348.50	0.52
3	113042	上银转债	1,437,079.90	0.52
4	113563	柳药转债	1,420,696.80	0.51
5	113021	中信转债	1,419,663.40	0.51
6	113044	大秦转债	1,403,020.80	0.51
7	110045	海澜转债	1,379,194.20	0.50
8	132009	17 中油 EB	1,097,040.00	0.40
9	113017	吉视转债	927,479.20	0.34
10	110080	东湖转债	925,247.60	0.33
11	110038	济川转债	822,730.00	0.30
12	128083	新北转债	818,692.17	0.30

13	132008	17 山高 EB	739,760.00	0.27
14	128132	交建转债	709,767.20	0.26
15	132015	18 中油 EB	666,191.30	0.24
16	113584	家悦转债	628,940.40	0.23
17	110064	建工转债	490,326.00	0.18
18	113036	宁建转债	416,581.20	0.15
19	113050	南银转债	410,570.40	0.15
20	113033	利群转债	407,155.20	0.15
21	113542	好客转债	273,121.20	0.10
22	128105	长集转债	142,912.00	0.05
23	128124	科华转债	142,129.00	0.05
24	128037	岩土转债	141,905.60	0.05
25	128117	道恩转债	141,836.80	0.05
26	113532	海环转债	85,677.90	0.03
27	113589	天创转债	85,460.40	0.03
28	123010	博世转债	76,146.40	0.03
29	110062	烽火转债	34,665.00	0.01

### 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

本报告期期初基金份额总额	287,770,866.01
本报告期基金总申购份额	482,140.18
减：本报告期基金总赎回份额	10,689,162.98
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	277,563,843.21

## §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 106 只公募基金。截至 2021 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模超 1653 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。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强化回报混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通强化回报混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通强化回报混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通强化回报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  
二〇二二年一月二十二日