

**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**

**2021 年年度报告**

**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：二〇二二年三月三十一日

## § 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。本年度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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 29 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。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|   |    |
|---|----|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| <b>§2 基金简介</b>                          | 5  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6  |
| 2.4 信息披露方式                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料                              | 6  |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>          | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现                              | 8  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 10 |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | 10 |
| 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遵规守信情况的说明              | 15 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 15 |
| 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             | 15 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 16 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 17 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 18 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 18 |
| 4.9 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       | 18 |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | 19 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明                  | 19 |
| 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 | 19 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见      | 19 |
| <b>§6 审计报告</b>                          | 19 |
| 6.1 审计意见                                | 19 |
| 6.2 形成审计意见的基础                           | 20 |
| 6.3 其他信息                                | 20 |
| 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任                     | 20 |
| 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任                     | 21 |
| <b>§7 年度财务报表</b>                        | 22 |
| 7.1 资产负债表                               | 22 |
| 7.2 利润表                                 | 23 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 25 |
| 7.4 报表附注                                | 26 |
| <b>§8 投资组合报告</b>                        | 50 |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 50 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 51 |
| 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合                | 51 |
| 8.3 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       | 51 |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                   | 51        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                  | 52        |
| 8.6 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        |
| 8.7 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        |
| 8.8 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 ..... | 53        |
| 8.9 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 .....    | 53        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 53        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 53        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                         | 53        |
| <b>§9 基金份额持有人信息</b> .....                   | <b>54</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 54        |
| 9.2 期末上市基金前十名持有人 .....                      | 54        |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 55        |
| 9.4 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 .....     | 55        |
| <b>§10 开放式基金份额变动</b> .....                  | <b>55</b> |
| <b>§11 重大事件揭示</b> .....                     | <b>56</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 56        |
| 11.2 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        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 56        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 56        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 56        |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 56        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 57        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 57        |
| <b>12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....              | <b>58</b> |
| <b>§13 备查文件目录</b> .....                     | <b>60</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 60        |
| 13.2 存放地点 .....                             | 60        |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 60        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                               |
|--------------|-------------------------------|
| 基金名称         | 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 |
| 基金简称         | 海富通上证 5 年期地方政府债 ETF           |
| 场内简称         | 5 年地债                         |
| 基金主代码        | 511060                        |
| 交易代码         | 511060                        |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                        |
| 基金合同生效日      | 2019 年 11 月 7 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                    |
| 报告期末基金份额总额   | 5,136,285.00 份                |
| 基金合同存续期      | 不定期                           |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所                       |
| 上市日期         | 2019-12-12                    |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金将紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争本基金的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 0.25%，年化跟踪误差不超过 3%。   |
| 投资策略   | 本基金为指数基金，将采用分层抽样复制法对业绩比较基准进行跟踪。当由于市场流动性不足或因法规规定等其他原因，导致标的指数成份券及备选成份券无法满足投资需求时，基金管理人可以在成份券及备选成份券外寻找其他债券构建替代组合，对指数进行跟踪复制。对于非成份券的债券，本基金综合运用久期调整、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进行日常管理。 |
| 业绩比较基准 | 上证 5 年期地方政府债指数收益率   |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券型基金，其预期收益及预期风险水平低  |

|  |  |
|--|--|
|  | 于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金属于指数基金，采用分层抽样复制策略，跟踪上证 5 年期地方政府债指数，其风险收益特征与标的指数所表征的债券市场组合的风险收益特征相似。 |
|--|--|

### 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                          | 招商银行股份有限公司             |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 岳冲                                   | 张燕                     |
|             | 联系电话 | 021-38650788                         | 0755-83199084          |
|             | 电子邮箱 | chongyue@hftfund.com                 | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话      |      | 40088-40099                          | 95555                  |
| 传真          |      | 021-33830166                         | 0755-83195201          |
| 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 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦   |
| 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 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦   |
| 邮政编码        |      | 200120                               | 518040                 |
| 法定代表人       |      | 杨仓兵                                  | 缪建民                    |

### 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《证券日报》  |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a> |
| 基金年度报告备置地点          | 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                        |
|--------|-------------------------|-----------------------------|
| 会计师事务所 | 毕马威华振会计师事务所<br>(特殊普通合伙) | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责             | 北京市西城区太平桥大                  |

|  |     |        |
|--|-----|--------|
|  | 任公司 | 街 17 号 |
|--|-----|--------|

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| <b>3.1.1 期间数据和指标</b> | <b>2021 年</b>  | <b>2020 年</b>  | <b>2019 年 11 月 7 日(基金合同生效日) 至 2019 年 12 月 31 日</b> |
|----------------------|----------------|----------------|--|
| 本期已实现收益              | 19,108,185.49  | 207,935,084.64 | 61,724,070.46                                      |
| 本期利润                 | 25,022,332.92  | 163,450,768.54 | 103,098,436.94                                     |
| 加权平均基金份额<br>本期利润     | 4.5324         | 4.8799         | 0.0582   |
| 本期加权平均净值<br>利润率      | 4.45%          | 4.75%          | 1.03%  |
| 本期基金份额净值<br>增长率      | 4.56%          | 2.28%          | 1.01%  |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | <b>2021 年末</b> | <b>2020 年末</b> | <b>2019 年末</b>                                     |
| 期末可供分配利润             | 11,848,405.00  | 6,684,524.17   | 50,388,340.23                                      |
| 期末可供分配基金<br>份额利润     | 2.3068         | 1.2140         | 0.6510   |
| 期末基金资产净值             | 525,476,906.22 | 557,313,025.39 | 7,817,677,635.66                                   |
| 期末基金份额净值             | 102.3068       | 101.2140       | 101.0084   |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | <b>2021 年末</b> | <b>2020 年末</b> | <b>2019 年末</b>                                     |
| 基金份额累计净值<br>增长率      | 8.02%          | 3.31%          | 1.01%  |

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)。

- 4、本基金已于 2019 年 11 月 15 日进行了基金份额折算，折算比例为 100:1。
- 5、本基金合同生效日为 2019 年 11 月 07 日，合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

### 3.2 基金净值表现

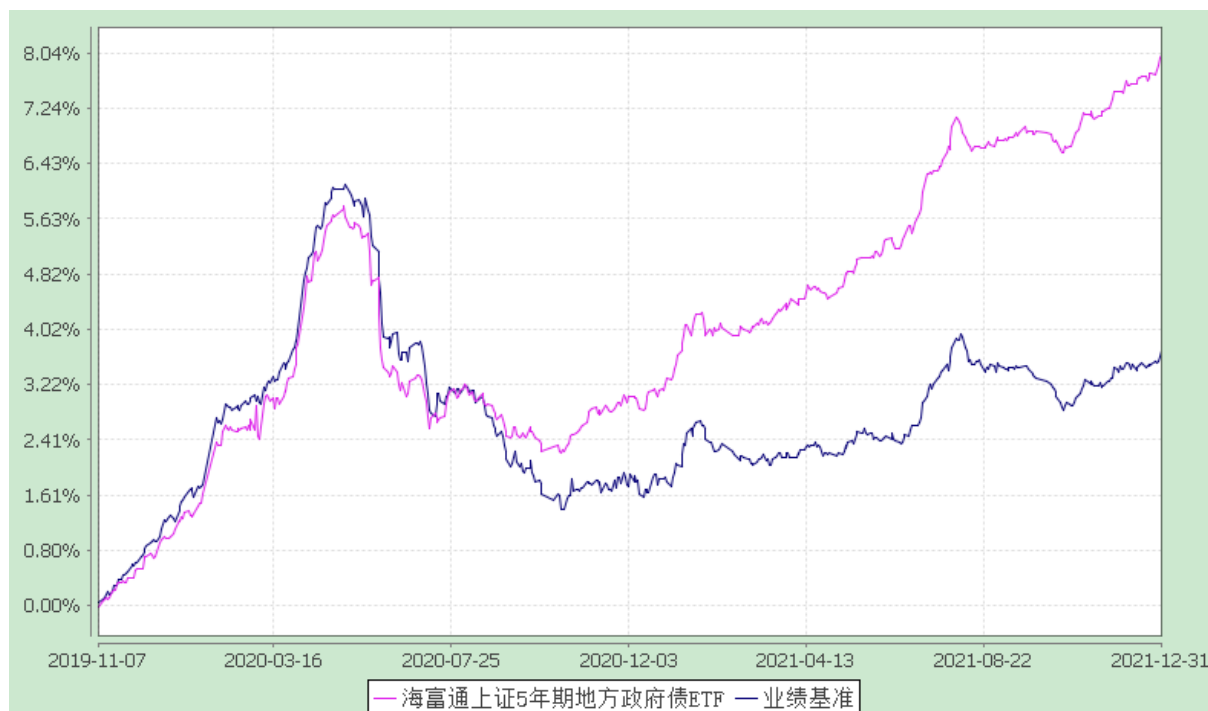
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月      | 1.05%    | 0.05%       | 0.40%      | 0.05%         | 0.65% | 0.00%  |
| 过去六个月      | 2.47%    | 0.06%       | 1.08%      | 0.06%         | 1.39% | 0.00%  |
| 过去一年       | 4.56%    | 0.06%       | 1.89%      | 0.06%         | 2.67% | 0.00%  |
| 自基金合同生效起至今 | 8.02%    | 0.09%       | 3.71%      | 0.10%         | 4.31% | -0.01% |

#### 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

海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金  
 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  
 (2019 年 11 月 7 日至 2021 年 12 月 31 日)

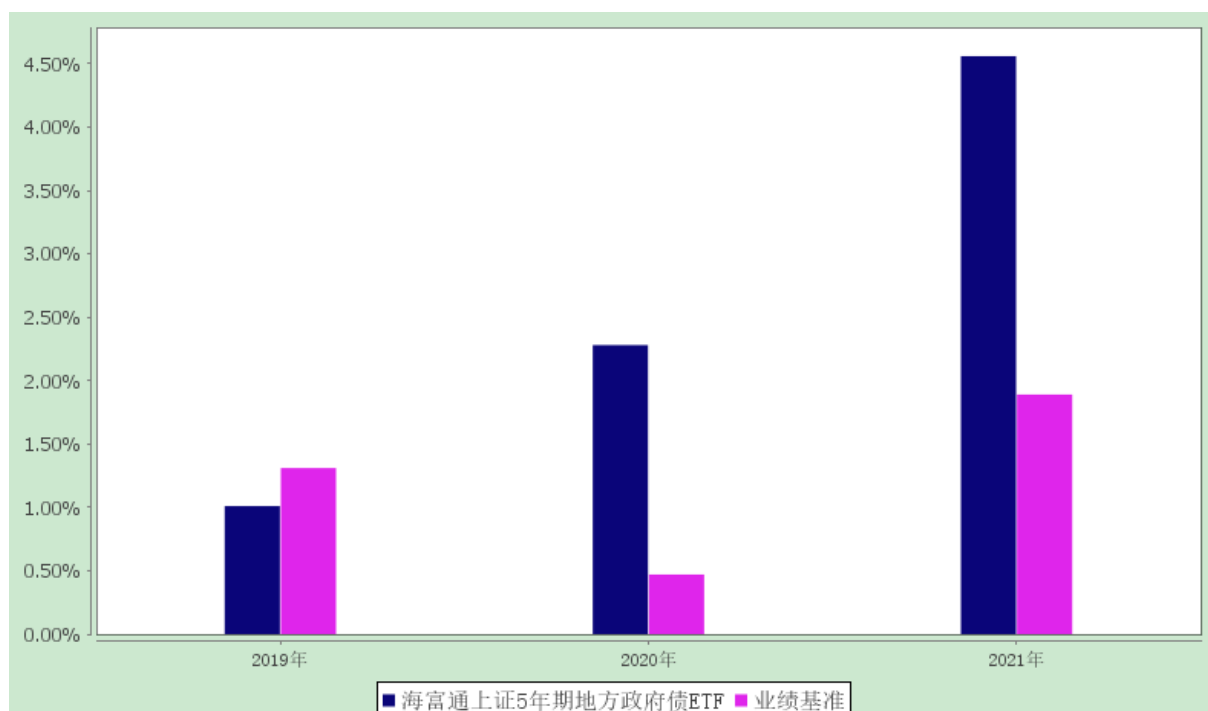




注：本基金合同于2019年11月7日生效。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通上证5年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金  
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：图中列示的 2019 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 11 月 7 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度     | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额      | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计      | 备注 |
|--------|-------------|---------------|-----------|---------------|----|
| 2021 年 | 34.500      | 19,081,683.25 | -         | 19,081,683.25 | -  |
| 2020 年 | 21.000      | 62,069,698.50 | -         | 62,069,698.50 | -  |
| 2019 年 | -           | -             | -         | -             | -  |
| 合计     | 55.500      | 81,151,381.75 | -         | 81,151,381.75 | -  |

## § 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 12 月 31 日，本基金管理人共管理 91 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、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、海富通利率债债券型证券投资基金、海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金、海富通瑞兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通欣利混合型证券投资基金、海富通碳中和主题混合型证券投资基金、海富通成长领航混合型证券投资基金、海富通养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）。

#### 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 |      |  |
|-----|----------------------------|------------|------|------|--|
| 陆丛凡 | 本基金的基金经理                   | 2019-07-03 | -    | 9 年  | 硕士，持有基金从业人员资格证书。曾任瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益定量分析师，2015 年 4 月加入海富通基金管理有限公司。2015 年 6 月至 2019 年 7 月任海富通固定收益部基金经理助理。2019 年 7 月起任海富通上证城投债 ETF、海富通上证 10 年期地方政府债 ETF、海富通上清所短融债券的基金经理。2019 年 10 月至 2021 年 5 月任海富通美元债（QDII）基金经理。2019 年 11 月起兼任海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金经理。2020 年 5 月至 2021 年 9 月兼任海富通中债 1-3 年国开债基金经理。2020 年 7 月起兼任海富通上证投资级可转债 ETF 基金经理。2020 年 8 月起兼任海富通中证短融 ETF 基金经理。2020 年 8 月至 2021 年 7 月兼任海富通中债 3-5 年国开债基金经理。2021 年 4 月起兼任海富通中债 1-3 年农发基金经理。2021 年 6 月起兼任海富通策略收益债券基金经理。 |
| 陈轶平 | 本基金的基金经理；固定收益投资总监兼债券基金部总监。 | 2014-11-13 | -    | 12 年 | 博士，CFA。持有基金从业人员资格证书。历任 Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师、瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事，2011 年 10 月加入海富通基金管理有限公司，历任债券投资经理、现金管理部副总监、债券基金部总监，现任固定收益投资总监兼债券基金部总监。2013 年 8 月至 2020 年 7 月任海富通货币基金经   |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | <p>理。2014 年 8 月至 2019 年 9 月兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2014 年 11 月起兼任海富通上证可质押城投债 ETF (现为海富通上证城投债 ETF) 基金经理。2015 年 12 月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015 年 12 月至 2017 年 9 月兼任海富通稳进增利债券 (LOF) 基金经理。2016 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通一年定开债券基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2016 年 8 月至 2019 年 10 月兼任海富通瑞丰一年定开债券 (现为海富通瑞丰债券) 基金经理。2016 年 8 月至 2017 年 11 月兼任海富通瑞益债券基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 10 月兼任海富通美元债 (QDII) 基金经理。2017 年 1 月至 2021 年 3 月兼任海富通上证周期产业债 ETF 基金经理。2017 年 2 月起兼任海富通瑞利债券基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 6 月兼任海富通富源债券基金经理。2017 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通瑞合纯债基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 9 月兼任海富通富睿混合 (现海富通沪深 300 指数增强) 基金经理。2017 年 7 月至 2019 年 9 月兼任海富通瑞福一年定开债券 (现为海富通瑞福债券)、海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2017 年 7 月至 2018 年 12 月兼任海富通欣悦混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通恒丰定开债券基金经理。2018 年</p> |
|--|--|--|--|--|

|     |            |            |   |     |   |
|-----|------------|------------|---|-----|---|
|     |            |            |   |     | 10 月起兼任海富通上证 10 年期地方政府债 ETF 基金经理。2018 年 11 月起兼任海富通弘丰定开债券基金经理。2019 年 1 月起兼任海富通上清所短融债券基金经理。2019 年 11 月起兼任海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金经理。2020 年 4 月起兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年 7 月起兼任海富通上证投资级可转债 ETF 基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通利率债债券基金经理。   |
| 唐灵儿 | 本基金的基金经理助理 | 2019-08-02 | - | 4 年 | 硕士，持有基金从业人员资格证书。2017 年 7 月加入海富通基金管理有限公司，曾任固定收益研究部助理固定收益分析师。2019 年 8 月起任海富通上证 10 年期地方政府债 ETF、海富通上证城投债 ETF 的基金经理助理。2019 年 11 月起兼任任海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 的基金经理助理。2020 年 12 月起兼任海富通中证短融 ETF 基金经理助理。2021 年 11 月起兼任海富通裕通 30 个月定开债券、海富通裕昇三年定开债券、海富通上证投资级可转债 ETF、海富通上清所短融债券、海富通中债 1-3 年农发、海富通瑞福债券、海富通瑞祥一年定开债券的基金经理助理。 |

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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了一级市场和二级市场的所有投资交易管理活动以及公司内部的证券分配，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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 年国内经济呈现逐季走低，全年录得 8.1% 的同比增速，两年平均增速为 5.1%。工业增加值表现平稳，但 9 月受到“能耗双控”的影响，当月同比增速跌破 5%；随后保供政策出台，生产逐月恢复，全年累计两年平均增速为 6.2%。地产投资方面，上半年受到竣工与销售面积支撑维持较高的增速，但下半年受到地产三道红线政策与银行贷款双集中的影响，当月同比增速转负，全年累计两年平均增速为 5.7%。基建投资增速在

缺乏项目与地方政府隐性债务严监管的情况下维持较低的增速，全年累计两年平均增速为 0.7%。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，全年累计两年平均增速为 5.4%。出口方面，受到海外发达国家经济复苏与财政补贴以及海外供应链受损的影响，全年出口维持较高增速，累计增速为 29.9%。通胀方面，CPI 在猪肉价格同比大幅回落的背景下维持较低的增速，但年末受极端天气影响蔬菜价格短期上升，全年累计同比上涨 0.9%。在生产边际修复、大宗商品涨价、国际油价回升、煤炭供给短缺等因素影响下，工业品通胀 10 月同比增速达到历史新高，但随着煤炭保供限价政策组合拳的推出 PPI 稍有回落，全年累计同比上涨 8.1%。货币政策方面，上半年总体偏紧，央行公开市场操作缩量回笼。下半年货币政策宽松，央行分别于 7 月与 12 月降准各 50bp，同时跨月公开市场操作提供充裕的流动性。信用环境方面，前 3 季度社融增速逐渐下滑，4 季度针对房企融资的政策纠偏，碳减排支持工具、下调支农支小再贷款利率等结构性货币政策工具陆续推出，社融增速见底反弹。对应债市而言，1-2 月货币宽松政策退出，资金面大幅收紧，10 年期国债收益率快速上行至 3.3% 的位置。3 月至 7 月，经济基本面边际走弱，流动性合理充裕，资金面维持平稳，而 7 月迎来年内的首次全面降准，10 年期国债收益率逐级下行至 2.8%。4 季度社融增速见底，市场宽信用预期开始升温，但同时宽货币又支撑债市，10 年期国债收益率保持在 2.8%-3% 的区间内震荡。全年来看，2021 年债市呈现小牛市行情，10 年期国债收益率全年下行 36BP。

地方债方面，5 年期地方债二级流动性延续区域分化、一般债优于专项债的态势；5 年期地方债收益率走势与 5 年国债收益率走势趋同，全年 5 年期 AAA 地方债收益率累计下行 38bp 至 2.90%，与 5 年期国债的利差累计收窄 4bp 至 29bp，与 4 年期 AAA 地方债的期限利差累计走阔 1bp 至 6bp。

作为指数基金，本基金延续抽样复制的方法，关注组合与指数的拟合度，控制跟踪偏离度及跟踪误差。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 4.56%，同期业绩比较基准收益率为 1.89%，基金净值跑赢业绩比较基准 2.67 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

经济基本面方面，工业生产维持稳定，在需求没有起色的情况下难超预期。地产投资可期待在需求较弱的三四线城市出现政策上的边际放松，但基于当前土拍面积与销售面积严重下滑的情况，地产投资仍是 2022 年经济增速的拖累项。基建投资在上半年项目储备充分，专项债资金充足到位的情况下上半年或表现较好，增速总体表现为前低后高。制造业投资在政策的支撑下有望成为经济的最大亮点，尤其是在新能源与新基建等相关领域。消费方面在疫情防控措施未放松的情况下或处于温和复苏的趋势。通胀方面，国内外需求均有走弱迹象，考虑到 2021 年高基数因素，2022 年 PPI 处于下行通道。CPI 方面，考虑到猪价在 2022 年下半年或开始反弹，届时将面临通胀压力。政策方面，随



着年底中央经济工作会议的召开，各个部委与地方政府开始表态，更多的托底与刺激政策或陆续推出。货币政策为配合宽信用政策将维持宽松，降准与降息也可以期待。对于债市而言，基本面处在政策出台但未见效果、短期经济动能仍偏弱的环境中，政策的发力受制于“房住不炒”、严控地方隐性债务等问题，短期结构性宽信用政策效果偏慢，上半年仍有做多的空间。但下半年经济企稳，若国内外流动性收紧需警惕债市收益率快速上行的风险。

未来，本基金将延续抽样复制的方法，关注组合与指数的拟合情况，力争降低组合的偏离度及跟踪误差。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2021 年，基金管理人监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则，通过业务审核、合规检查、系统监控、重点抽查、专项稽核等一系列方式开展工作，强化基金运作和公司运营的合规性，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报董事会和公司管理层。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

一、加强合规管理，持续完善公司的规章制度，健全内控体系，落实内控责任。

报告期内，坚持以法律法规和公司制度为依据，对公司和基金运作的各项业务开展提供全面的合规咨询、审核、监测与检查，确保基金运作的合法合规性。根据法律法规、监管政策的变化及公司管理需要，新增和修订了多项内部制度和流程，并持续倡导合规文化建设，提升了公司内部控制环境建设。优化督察稽核部合规、审计部门架构，增设投资、销售、运营条线专职合规人员，完善了公司内部控制三层控制体系，强化了各项内控职责，为公司各项业务合规开展及基金持有人利益最大化提供有力的保障。

二、客观开展内外部内控评估，进一步完善内控措施。

根据法规、监管要求并结合风险导向和全覆盖原则，对各部门的业务有重点的开展了多项专项检查和内部审计，同时积极配合外部机构对公司开展审计和内控评估等工作，通过及时跟踪落实各项问题的整改情况，严格控制了各部门的主要风险，加强并完善了公司的内部控制状况。

三、有效推进反洗钱与反恐怖融资工作。

报告期内，结合反洗钱法规及公司业务特点完善了反洗钱制度及流程，组织多场反洗钱专项培训、考试和宣传活动；基于风险为本的工作思路，继续开展全面的客户信息核查清理工作，稳步推进代销机构分类管理工作，持续优化系统和监测模型，强化对大额交易和可疑交易方面的监控，并按时向中国反洗钱监测分析中心报送相关数据。报告期内，公司根据监管要求完成了 2020 年度的洗钱风险自评估工作。

四、强化法规学习，组织开展内外部培训，提升员工的合规及风险意识。

本报告期内，为提高公司全员的合规意识，进一步加强组织各类合规培训频率，及时对法规、监管精神和公司要求进行宣导，并组织全体员工开展各类内外部培训，剖析

风险案例，并通过结合内部考试系统多次组织了线上培训及在线考试。通过培训，增强了员工的合规意识和风险防范意识，提升了员工的主动识别和控制业务风险的积极性和能力。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，维护和保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续加强内部控制和风险管理，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金财产安全、合规、诚信运作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金报告期内进行过四次分配，分别以截止 2021 年 01 月 08 日，2021 年 05 月 06 日，2021 年 08 月 16 日，2021 年 11 月 04 日本基金的可供分配利润为基准。四次分红分别于 2021 年 01 月 20 日，2021 年 05 月 18 日，2021 年 08 月 26 日，2021 年 11 月 17 日完成权益登记，单位分红金额分别为 1.0000 元，0.7500 元，0.7000 元，1.0000 元，合计利润分配金额 19,081,683.25 元，符合基金合同规定。

#### 4.9 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

本基金分别自 2020 年 11 月 9 日至 2021 年 1 月 28 日、自 2021 年 5 月 19 日至 2021 年 8 月 9 日、自 2021 年 8 月 17 日至 2021 年 11 月 15 日，均出现连续五十八个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。自 2021 年 2 月 3 日至 2021 年 4 月 30 日，存在连续五十七个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。自 2021 年 11 月 24 日

至 2021 年 12 月 31 日，存在连续二十八个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

## § 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

毕马威华振审字第 2200078 号

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全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了后附的海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金”)财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表、2021 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 其他信息

海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金管理人海富通基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金 2021 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

## 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，

除非海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师

王国蓓 倪益

北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

2022 年 3 月 29 日

## §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：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

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                         |                          |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 19,811,209.21           | 33,912,619.61            |
| 结算备付金           | 7.4.10.6   | 333,181.82              | -                        |
| 存出保证金           |            | 1,217.70                | 48,691.45                |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 496,942,109.60          | 515,814,850.00           |
| 其中：股票投资         |            | -                       | -                        |
| 基金投资            |            | -                       | -                        |
| 债券投资            |            | 496,942,109.60          | 515,814,850.00           |
| 资产支持证券投资        |            | -                       | -                        |
| 贵金属投资           |            | -                       | -                        |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                       | -                        |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | 15,000,000.00           | -                        |
| 应收证券清算款         |            | 140,659.70              | -                        |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 8,702,882.90            | 7,845,695.63             |
| 应收股利            |            | -                       | -                        |
| 应收申购款           |            | -                       | -                        |
| 递延所得税资产         |            | -                       | -                        |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                       | -                        |
| 资产总计            |            | 540,931,260.93          | 557,621,856.69           |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末</b>              | <b>上年度末</b>              |

|               |          | 2021 年 12 月 31 日 | 2020 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| <b>负 债:</b>   |          |                  |                  |
| 短期借款          |          | -                | -                |
| 交易性金融负债       |          | -                | -                |
| 衍生金融负债        | 7.4.7.3  | -                | -                |
| 卖出回购金融资产款     |          | -                | -                |
| 应付证券清算款       |          | 15,153,028.15    | -                |
| 应付赎回款         |          | -                | -                |
| 应付管理人报酬       |          | 70,864.16        | 70,554.75        |
| 应付托管费         |          | 23,621.41        | 23,518.26        |
| 应付销售服务费       |          | -                | -                |
| 应付交易费用        | 7.4.7.7  | 3,425.00         | 1,771.01         |
| 应交税费          |          | -                | -                |
| 应付利息          |          | -                | -                |
| 应付利润          |          | -                | -                |
| 递延所得税负债       |          | -                | -                |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 203,415.99       | 212,987.28       |
| 负债合计          |          | 15,454,354.71    | 308,831.30       |
| <b>所有者权益:</b> |          |                  |                  |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 513,628,501.22   | 550,628,501.22   |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | 11,848,405.00    | 6,684,524.17     |
| 所有者权益合计       |          | 525,476,906.22   | 557,313,025.39   |
| 负债和所有者权益总计    |          | 540,931,260.93   | 557,621,856.69   |

注: 报告截止日 2021 年 12 月 31 日, 基金份额净值 102.3068 元, 基金份额总额 5,136,285.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体: 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

本报告期: 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

| 项目   | 附注号 | 本期                                  | 上年度可比期间                             |
|------|-----|-------------------------------------|-------------------------------------|
|      |     | 2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 12 月 31 日 | 2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 12 月 31 日 |
| 一、收入 |     | 26,519,080.07                       | 171,685,271.23                      |

|                            |            |                      |                       |
|----------------------------|------------|----------------------|-----------------------|
| 1.利息收入                     |            | 17,517,370.73        | 106,931,892.13        |
| 其中：存款利息收入                  | 7.4.7.11   | 62,195.80            | 314,213.12            |
| 债券利息收入                     |            | 17,362,234.80        | 105,738,626.44        |
| 资产支持证券利息收入                 |            | -                    | -                     |
| 买入返售金融资产收入                 |            | 92,940.13            | 879,052.57            |
| 证券出借利息收入                   |            | -                    | -                     |
| 其他利息收入                     |            | -                    | -                     |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |            | 3,086,261.27         | 109,248,505.60        |
| 其中：股票投资收益                  | 7.4.7.12   | -                    | -                     |
| 基金投资收益                     |            | -                    | -                     |
| 债券投资收益                     | 7.4.7.13   | 3,086,261.27         | 109,248,505.60        |
| 资产支持证券投资收益                 |            | -                    | -                     |
| 贵金属投资收益                    | 7.4.7.14   | -                    | -                     |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.15   | -                    | -                     |
| 股利收益                       | 7.4.7.16   | -                    | -                     |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 7.4.7.17   | 5,914,147.43         | -44,484,316.10        |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |            | -                    | -                     |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 7.4.7.18   | 1,300.64             | -10,810.40            |
| <b>减：二、费用</b>              |            | <b>1,496,747.15</b>  | <b>8,234,502.69</b>   |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 842,823.11           | 5,248,672.37          |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 280,940.95           | 1,749,557.45          |
| 3. 销售服务费                   |            | -                    | -                     |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.19   | 40,855.23            | 29,671.13             |
| 5. 利息支出                    |            | -                    | -                     |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -                    | -                     |
| 6. 税金及附加                   |            | -                    | -                     |
| 7. 其他费用                    | 7.4.7.20   | 332,127.86           | 1,206,601.74          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | <b>25,022,332.92</b> | <b>163,450,768.54</b> |
| 减：所得税费用                    |            | -                    | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | <b>25,022,332.92</b> | <b>163,450,768.54</b> |



**7.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：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

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目   | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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<br>(基金净值)                                | 550,628,501.22                              | 6,684,524.17    | 557,313,025.39    |
| 二、本期经营活动产生<br>的基金净值变动数<br>(本期利润)                   | -   | 25,022,332.92   | 25,022,332.92     |
| 三、本期基金份额交易<br>产生的基金净值变<br>动数(净值减少以“-”<br>号填列)      | -37,000,000.00                              | -776,768.84     | -37,776,768.84    |
| 其中：1.基金申购款   | 5,000,000.02                                | 88,807.52       | 5,088,807.54      |
| 2.基金赎回款  | -42,000,000.02                              | -865,576.36     | -42,865,576.38    |
| 四、本期向基金份额<br>持有人分配利润产生<br>的基金净值变动(净<br>值减少以“-”号填列) | -   | -19,081,683.25  | -19,081,683.25    |
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)                                | 513,628,501.22                              | 11,848,405.00   | 525,476,906.22    |
| 项目   | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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<br>(基金净值)                                | 7,739,628,519.55                            | 78,049,116.11   | 7,817,677,635.66  |
| 二、本期经营活动产生<br>的基金净值变动数<br>(本期利润)                   | -   | 163,450,768.54  | 163,450,768.54    |
| 三、本期基金份额交<br>易产生的基金净值变                             | -7,189,000,018.33                           | -172,745,661.98 | -7,361,745,680.31 |

|  |                   |                 |                   |
|--|-------------------|-----------------|-------------------|
| 动数（净值减少以“-”号填列）                        |                   |                 |                   |
| 其中：1.基金申购款                             | 23,000,000.00     | 351,699.06      | 23,351,699.06     |
| 2.基金赎回款                                | -7,212,000,018.33 | -173,097,361.04 | -7,385,097,379.37 |
| 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） | -                 | -62,069,698.50  | -62,069,698.50    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 550,628,501.22    | 6,684,524.17    | 557,313,025.39    |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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(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[2019]1155 号《关于准予海富通上证 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《海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 10,978,432,537.00 元。经向中国证监会备案，《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基金合同》于 2019 年 11 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,978,628,537.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 196,000.00 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《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基金合同》和《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招募说明书》的有关规定，基金合同生效后，海富通基金管理有限公司可以对本基金进行基金份额折算与变更登记。根据 2019 年 11 月 13 日《海富通基金管理有限公司关于海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告》，本基金管理人于 2019 年 11 月 15 日对各基金份额持有人认购的基金份额进行折算。本基金折算前基金份额总额为 10,978,628,537.00 份，折算前基金份额净值为 1.0012 元；根据本基金的基金份额折算方法，折算后基金份额总额为 109,786,285.00 份，折算后基金份额净值为 100.1183 元。

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）上证基字[2019]第 273 号文审核同意，本基金于 2019 年 12 月 12 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数上证 5 年期地方政府债指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金主要投资于标的指数成份债券和备选成份债券，该部分资产的投资比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金还可以投资于国内依法发行上市的其他债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具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）。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.25%，年化跟踪误差不超过 3%。本基金的业绩比较基准：上证 5 年期地方政府债指数收益率。

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 2022 年 3 月 29 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况、2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。
- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。
- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平

准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资收益和资产支持证券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业或兑付机构代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行债券、资产支持证券等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在受益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《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基金合同》的规定，基金收益分配采用现金方式每一基金份额享有同等分配权；基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 0.05% 以上，方可进行收益分配；本基金收益每年最多分配 12 次。每次基金收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后可能使除息后的基金份额净值低于面值；若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下经与基金托管人协商一致后酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介上公告。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外）和银行间同业市场交易的固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 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：

(a) 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。

(b) 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。

(c) 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。

(d) 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。

(e) 本基金城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款



单位：人民币元

| 项目           | 本期末           | 上年度末          |
|--------------|---------------|---------------|
|              | 2021年12月31日   | 2020年12月31日   |
| 活期存款         | 19,811,209.21 | 33,912,619.61 |
| 定期存款         | -             | -             |
| 其中：存款期限1个月以内 | -             | -             |
| 存款期限1-3个月    | -             | -             |
| 存款期限3个月以上    | -             | -             |
| 其他存款         | -             | -             |
| 合计           | 19,811,209.21 | 33,912,619.61 |

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末            |                |                |               |
|---------------|----------------|----------------|----------------|---------------|
|               | 2021年12月31日    |                |                |               |
|               | 成本             | 公允价值           | 公允价值变动         |               |
| 股票            | -              | -              | -              |               |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -              | -              | -              |               |
| 债券            | 交易所市场          | 474,057,711.79 | 476,830,109.60 | 2,772,397.81  |
|               | 银行间市场          | 20,080,200.00  | 20,112,000.00  | 31,800.00     |
|               | 合计             | 494,137,911.79 | 496,942,109.60 | 2,804,197.81  |
| 资产支持证券        | -              | -              | -              |               |
| 基金            | -              | -              | -              |               |
| 其他            | -              | -              | -              |               |
| 合计            | 494,137,911.79 | 496,942,109.60 | 2,804,197.81   |               |
| 项目            | 上年度末           |                |                |               |
|               | 2020年12月31日    |                |                |               |
|               | 成本             | 公允价值           | 公允价值变动         |               |
| 股票            | -              | -              | -              |               |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -              | -              | -              |               |
| 债券            | 交易所市场          | 502,632,095.62 | 499,843,650.00 | -2,788,445.62 |

|        |       |                |                |               |
|--------|-------|----------------|----------------|---------------|
|        | 银行间市场 | 16,292,704.00  | 15,971,200.00  | -321,504.00   |
|        | 合计    | 518,924,799.62 | 515,814,850.00 | -3,109,949.62 |
| 资产支持证券 |       | -              | -              | -             |
| 基金     |       | -              | -              | -             |
| 其他     |       | -              | -              | -             |
| 合计     |       | 518,924,799.62 | 515,814,850.00 | -3,109,949.62 |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日  |           |
|-------|--------------------------|-----------|
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 15,000,000.00            | -         |
| 银行间市场 | -                        | -         |
| 合计    | 15,000,000.00            | -         |
| 项目    | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |           |
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                        | -         |
| 银行间市场 | -                        | -         |
| 合计    | -                        | -         |

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息   | 2,055.31                | 1,294.94                 |
| 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  | 164.89                  | -                        |
| 应收债券利息     | 8,700,662.15            | 7,844,376.60             |
| 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    | -                       | -                        |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                       | -                        |
| 应收出借证券利息   | -                       | -                        |
| 其他         | 0.55                    | 24.09                    |
| 合计         | 8,702,882.90            | 7,845,695.63             |

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                       | -                        |
| 银行间市场应付交易费用 | 3,425.00                | 1,771.01                 |
| 合计          | 3,425.00                | 1,771.01                 |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | -                       | -                        |
| 应付证券出借违约金   | -                       | -                        |
| 预提费用        | 175,000.00              | 185,000.00               |

|         |            |            |
|---------|------------|------------|
| 应付指数使用费 | 28,415.99  | 27,987.28  |
| 合计      | 203,415.99 | 212,987.28 |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |                |
|---------------|--|----------------|
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额           |
| 上年度末          | 5,506,285.00                           | 550,628,501.22 |
| 本期申购          | 50,000.00                              | 5,000,000.02   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -420,000.00                            | -42,000,000.02 |
| 本期末           | 5,136,285.00                           | 513,628,501.22 |

注：投资者申购和赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

#### 7.4.7.10 未分配利润

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           | 17,905,537.88  | -11,221,013.71 | 6,684,524.17   |
| 本期利润           | 19,108,185.49  | 5,914,147.43   | 25,022,332.92  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,173,737.61  | 396,968.77     | -776,768.84    |
| 其中：基金申购款       | 144,609.79     | -55,802.27     | 88,807.52      |
| 基金赎回款          | -1,318,347.40  | 452,771.04     | -865,576.36    |
| 本期已分配利润        | -19,081,683.25 | -              | -19,081,683.25 |
| 本期末            | 16,758,302.51  | -4,909,897.51  | 11,848,405.00  |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12<br>月31日 |
|----------|---------------------------------|--------------------------------------|
|          | 活期存款利息收入                        | 60,524.26                            |
| 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 | 1,541.48  | 15,669.53  |
| 其他        | 130.06    | 256.04     |
| 合计        | 62,195.80 | 314,213.12 |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2021年1月1日至2021<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020<br>年12月31日 |
|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 2,833,040.33                    | 41,780,772.42                        |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | 253,220.94                      | 67,467,733.18                        |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -                               | -                                    |
| 合计                            | 3,086,261.27                    | 109,248,505.60                       |

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2021年1月1日至2021年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年<br>12月31日 |
|-------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 605,912,541.24                  | 2,838,536,670.88                     |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 596,556,148.77                  | 2,770,791,611.08                     |
| 减：应收利息总额                | 6,523,352.14                    | 25,964,287.38                        |
| 买卖债券差价收入                | 2,833,040.33                    | 41,780,772.42                        |

##### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年1月1日至2021年 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年 |
|----|-----------------------|----------------------------|
|----|-----------------------|----------------------------|

|              | 12月31日        | 12月31日           |
|--------------|---------------|------------------|
| 赎回基金份额对价总额   | 42,865,576.38 | 7,385,097,379.37 |
| 减：现金支付赎回款总额  | -531,039.11   | 100,080,621.30   |
| 减：赎回债券成本总额   | 42,299,679.06 | 7,075,242,590.82 |
| 减：赎回债券应收利息总额 | 843,715.49    | 142,306,434.07   |
| 赎回差价收入       | 253,220.94    | 67,467,733.18    |

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益申购差价收入。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无股利收益。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月<br>31日 |
|----------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 1.交易性金融资产                  | 5,914,147.43                    | -44,484,316.10                       |
| ——股票投资                     | -                               | -                                    |
| ——债券投资                     | 5,914,147.43                    | -44,484,316.10                       |
| ——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<br>变动产生的预估增值税 | -                               | -                                    |

|    |              |                |
|----|--------------|----------------|
| 合计 | 5,914,147.43 | -44,484,316.10 |
|----|--------------|----------------|

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                           | -                                |
| 替代损益    | 1,300.64                    | -10,810.40                       |
| 合计      | 1,300.64                    | -10,810.40                       |

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月<br>31日 |
|-----------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 2.90                            | 751.88                               |
| 银行间市场交易费用 | 40,852.33                       | 28,919.25                            |
| 交易基金产生的费用 | -                               | -                                    |
| 其中：申购费    | -                               | -                                    |
| 赎回费       | -                               | -                                    |
| 合计        | 40,855.23                       | 29,671.13                            |

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年1月1日至2021年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31<br>日 |
|---------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 审计费用    | 55,000.00                       | 49,322.80                            |
| 信息披露费   | 120,000.00                      | 120,000.00                           |
| 证券出借违约金 | -                               | -                                    |
| 银行划款手续费 | 7,151.41                        | 22,206.03                            |

|           |            |              |
|-----------|------------|--------------|
| 指数使用费     | 112,376.45 | 699,822.91   |
| 其他费用      | 1,200.00   | 284,950.00   |
| 债券托管账户维护费 | 36,000.00  | 30,300.00    |
| 开户费       | 400.00     | -            |
| 合计        | 332,127.86 | 1,206,601.74 |

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2022 年 3 月 15 日宣告 2022 年度第 1 次分红，向截至 2022 年 3 月 17 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 8.00 元。

## 7.4.9 关联方关系

| 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   |
| 招商银行股份有限公司(“招商银行”)  | 基金托管人          |
| 海通证券股份有限公司(“海通证券”)  | 基金管理人的股东、一级交易商 |
| 法国巴黎资产管理 BE 控股公司(BNP Paribas Asset Management BE Holding) | 基金管理人的股东       |
| 上海富诚海富通资产管理有限公司   | 基金管理人的子公司      |
| 海富通资产管理(香港)有限公司   | 基金管理人的子公司      |

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，本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。



**7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有应支付关联方的佣金。

**7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2021年1月1日至2021年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年<br>12月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 842,823.11                      | 5,248,672.37                         |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | -                               | -                                    |

注：支付基金管理人海富通基金管理有限公司的基金管理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。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021年1月1日至2021年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年<br>12月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 280,940.95                      | 1,749,557.45                         |

注：支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

单位：人民币元

| 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |        |      |       |      |       |      |
|-----------------------------|--------|------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场<br>交易的各关<br>联方名称      | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                             | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 招商银行                        | -      | -    | -     | -    | -     | -    |
| 上年度可比期间                     |        |      |       |      |       |      |

| 2020年1月1日至2020年12月31日  |               |      |       |          |       |          |
|------------------------|---------------|------|-------|----------|-------|----------|
| 银行间市场<br>交易的各关<br>联方名称 | 债券交易金额        |      | 基金逆回购 |          | 基金正回购 |          |
|                        | 基金买入          | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收<br>入 | 交易金额  | 利息支<br>出 |
| 招商银行                   | 20,003,147.54 | -    | -     | -        | -     | -        |

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 7.4.10.4.2 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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间均未持有过本基金。

##### 7.4.10.5.2 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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末2021年12月31日 |                              | 上年度末2020年12月31日 |                              |
|-------|----------------|------------------------------|-----------------|------------------------------|
|       | 持有的基金份额        | 持有的基金<br>份额占基金<br>总份额的比<br>例 | 持有的基金份额         | 持有的基金<br>份额占基金<br>总份额的比<br>例 |
| 招商银行  | 3,552.00       | 0.07%                        | 3,552.00        | 0.06%                        |

#### 7.4.10.6 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<br>2021年1月1日至2021年12月31<br>日 |        | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31<br>日 |        |
|-------|---------------------------------|--------|--------------------------------------|--------|
|       | 期末余额                            | 当期利息收入 | 期末余额                                 | 当期利息收入 |

|      |               |           |               |            |
|------|---------------|-----------|---------------|------------|
| 招商银行 | 19,811,209.21 | 60,524.26 | 33,912,619.61 | 298,287.55 |
|------|---------------|-----------|---------------|------------|

注：本基金通过“招商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2021 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 333,181.82 元。（2020 年 12 月 31 日：人民币 0.00 元）

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日      | 除息日        | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额      | 再投资形式发放总额 | 本期利润分配合计      | 备注 |
|----|------------|------------|---------------|---------------|-----------|---------------|----|
| 1  | 2021-01-20 | 2021-01-21 | 10.000        | 5,506,285.00  | -         | 5,506,285.00  | -  |
| 2  | 2021-05-18 | 2021-05-19 | 7.500         | 4,129,713.75  | -         | 4,129,713.75  | -  |
| 3  | 2021-08-26 | 2021-08-27 | 7.000         | 3,889,399.50  | -         | 3,889,399.50  | -  |
| 4  | 2021-11-17 | 2021-11-18 | 10.000        | 5,556,285.00  | -         | 5,556,285.00  | -  |
| 合计 |            |            | 34.500        | 19,081,683.25 | -         | 19,081,683.25 | -  |

注：本基金的基金管理人于 2022 年 3 月 15 日宣告 2022 年度第 1 次分红，向截至 2022 年 3 月 17 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 8.00 元。

#### 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

#### **7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

于 2021 年 12 月 31 日，本基金无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

##### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

于 2021 年 12 月 31 日，本基金无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

#### **7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### **7.4.13 金融工具风险及管理**

#### **7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金是指数型基金，紧密跟踪标的指数上证 5 年期地方政府债指数，具有和标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中的中低风险品种。本基金以标的指数成份债券和备选成份债券为主要投资对象，采用优化抽样复制法，通过对各成份债券和备选成份债券历史数据和流动性分析，选取流动性较好的债券构建组合，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。当在因特殊情况(如指数编制规则调整等)导致跟踪偏离度和跟踪误差超过风险控制目标，基金管理人将搭配使用其他合理方法采取合理措施，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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多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。

#### 7.4.13.2 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于信用良好的银行，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 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和资产支持证券占基金资产净值的比例为 94.57%（2020 年 12 月 31 日：92.55%）。

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。

##### 7.4.13.2.1 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<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 496,942,109.60     | 515,814,850.00      |
| AAA 以下 | -                  | -                   |
| 未评级    | -                  | -                   |
| 合计     | 496,942,109.60     | 515,814,850.00      |

#### 7.4.13.3 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 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个半月以内且不计息，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。

#### 7.4.13.3.1 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）。

本基金所持的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 7.4.12。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 12 月 31 日，本基金未持有流动性受限资产。

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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

本基金主要投资于交易所市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021年12月31日 | 1年以内          | 1-5年           | 5年以上 | 不计息 | 合计             |
|--------------------|---------------|----------------|------|-----|----------------|
| 资产                 |               |                |      |     |                |
| 银行存款               | 19,811,209.21 | -              | -    | -   | 19,811,209.21  |
| 结算备付金              | 333,181.82    | -              | -    | -   | 333,181.82     |
| 存出保证金              | 1,217.70      | -              | -    | -   | 1,217.70       |
| 交易性金融资产            | -             | 496,942,109.60 | -    | -   | 496,942,109.60 |
| 买入返售金融资产           | 15,000,000.00 | -              | -    | -   | 15,000,000.00  |

|  |               |                |              |               |                |
|--|---------------|----------------|--------------|---------------|----------------|
| 应收证券清算款                                | -             | -              | -            | 140,659.70    | 140,659.70     |
| 应收利息                                   | -             | -              | -            | 8,702,882.90  | 8,702,882.90   |
| 资产总计                                   | 35,145,608.73 | 496,942,109.60 | -            | 8,843,542.60  | 540,931,260.93 |
| 负债                                     |               |                |              |               |                |
| 应付证券清算款                                | -             | -              | -            | 15,153,028.15 | 15,153,028.15  |
| 应付管理人报酬                                | -             | -              | -            | 70,864.16     | 70,864.16      |
| 应付托管费                                  | -             | -              | -            | 23,621.41     | 23,621.41      |
| 应付交易费用                                 | -             | -              | -            | 3,425.00      | 3,425.00       |
| 其他负债                                   | -             | -              | -            | 203,415.99    | 203,415.99     |
| 负债总计                                   | -             | -              | -            | 15,454,354.71 | 15,454,354.71  |
| 利率敏感度缺口                                | 35,145,608.73 | 496,942,109.60 | -            | -6,610,812.11 | 525,476,906.22 |
| <b>上年度末</b><br><b>2020 年 12 月 31 日</b> | <b>1 年以内</b>  | <b>1-5 年</b>   | <b>5 年以上</b> | <b>不计息</b>    | <b>合计</b>      |
| 资产                                     |               |                |              |               |                |
| 银行存款                                   | 33,912,619.61 | -              | -            | -             | 33,912,619.61  |
| 存出保证金                                  | 48,691.45     | -              | -            | -             | 48,691.45      |
| 交易性金融资产                                | -             | 515,814,850.00 | -            | -             | 515,814,850.00 |
| 应收利息                                   | -             | -              | -            | 7,845,695.63  | 7,845,695.63   |
| 资产总计                                   | 33,961,311.06 | 515,814,850.00 | -            | 7,845,695.63  | 557,621,856.69 |
| 负债                                     |               |                |              |               |                |
| 应付管理人报酬                                | -             | -              | -            | 70,554.75     | 70,554.75      |
| 应付托管费                                  | -             | -              | -            | 23,518.26     | 23,518.26      |
| 应付交易费用                                 | -             | -              | -            | 1,771.01      | 1,771.01       |
| 其他负债                                   | -             | -              | -            | 212,987.28    | 212,987.28     |
| 负债总计                                   | -             | -              | -            | 308,831.30    | 308,831.30     |
| 利率敏感度缺口                                | 33,961,311.06 | 515,814,850.00 | -            | 7,536,864.33  | 557,313,025.39 |

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进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 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<br>2021 年 12 月 31 日     | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|    | 市场利率上升 25 个基点    | -4,961,265.03               | -5,190,816.16            |
|    | 市场利率下降 25 个基点    | 5,026,079.54                | 5,259,236.52             |



#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

本基金为指数基金，将采用分层抽样复制法对业绩比较基准进行跟踪。本基金将首先通过对标的指数中各成份债券的信用评级、历史流动性及收益率等进行分析，初步选择流动性较好的成份券作为备选，其次将通过对标的指数按照久期、剩余期限、信用等级、到期收益率以及债券发行主体所在区域等进行分层抽样，以使构建组合与标的指数在以上特征上尽可能相似，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。由于采用抽样复制，本基金组合中的个券只数、权重和债券品种与标的指数可能存在差异。此外本基金在控制跟踪误差的前提下，可通过风险可控的积极管理获得超额收益，以弥补基金费用等管理成本，控制与标的指数的偏离度。

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，投资于标的指数成份债券和备选成份债券的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。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，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性权益类投资(2020 年 12 月 31 日：同)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日：同)。

### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 7.4.14.1 以公允价值计量的资产和负债

下文列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的

报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为人民币 496,942,109.60 元，无属于第一或第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：属于第二层次的余额为人民币 515,814,850.00 元，无属于第一或第三层次的余额)。

#### (a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

#### (b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2020 年 12 月 31 日：无)。

#### 7.4.14.2 其他金融工具的公允价值 (期末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 7.4.14.3 其他事项

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。本基金将按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日(即 2022 年 1 月 1 日)未终止确认的金融工具的分类和计量(含减值)进行追溯调整。本基金将不调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益或其他综合收益。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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<br>(%) |
|----|-------------------|----------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | -              | -                |
|    | 其中：股票             | -              | -                |
| 2  | 基金投资              | -              | -                |
| 3  | 固定收益投资            | 496,942,109.60 | 91.87            |
|    | 其中：债券             | 496,942,109.60 | 91.87            |
|    | 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          | 15,000,000.00  | 2.77             |
|    | 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      | 20,144,391.03  | 3.72             |
| 8  | 其他各项资产            | 8,844,760.30   | 1.64             |
| 9  | 合计                | 540,931,260.93 | 100.00           |

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.2.2 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。

## 8.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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

本基金本报告期内未进行股票投资。

**8.4.2 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**

本基金本报告期内未进行股票投资。

**8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

本基金本报告期内未进行股票投资。

**8.5 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      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | -              | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -            |
| 4  | 企业债券      | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -            |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | 496,942,109.60 | 94.57        |
| 10 | 合计        | 496,942,109.60 | 94.57        |

**8.6 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  | 173430 | 21 江西 09 | 358,500 | 36,387,750.00 | 6.92         |
| 2  | 173446 | 21 安徽 17 | 358,000 | 36,337,000.00 | 6.92         |
| 3  | 173279 | 21 宁波 05 | 300,000 | 30,387,000.00 | 5.78         |
| 4  | 173401 | 21 广东 34 | 300,000 | 30,279,000.00 | 5.76         |
| 5  | 160099 | 19 山东 41 | 258,000 | 26,292,780.00 | 5.00         |

**8.7 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。

**8.8 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。

**8.9 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。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.10.1 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。

**8.10.2 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。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 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。

**8.11.2 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。

**8.11.3 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。

**8.12 投资组合报告附注**

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

**8.12.2** 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。

**8.12.3 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   | 1,217.70   |
| 2  | 应收证券清算款 | 140,659.70 |
| 3  | 应收股利    | -          |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 4 | 应收利息  | 8,702,882.90 |
| 5 | 应收申购款 | -            |
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 待摊费用  | -            |
| 8 | 其他    | -            |
| 9 | 合计    | 8,844,760.30 |

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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 |
| 166      | 30,941.48 | 5,089,595.00 | 99.09% | 46,690.00 | 0.91%  |

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称                        | 持有份额(份)      | 占上市总份额比例 |
|----|------------------------------|--------------|----------|
| 1  | 中国平安财产保险股份有限公司-自有资金          | 2,605,147.00 | 50.72%   |
| 2  | 登记结算系统债券回购质押专用账户(中信证券股份有限公司) | 800,000.00   | 15.58%   |
| 3  | 登记结算系统债券回购质                  | 738,000.00   | 14.37%   |

|    |                                  |            |       |
|----|----------------------------------|------------|-------|
|    | 押专用账户(中国银河证券股份有限公司)              |            |       |
| 4  | 登记结算系统债券回购质押专用账户(华安证券股份有限公司)     | 475,500.00 | 9.26% |
| 5  | 中国国际金融股份有限公司                     | 299,895.00 | 5.84% |
| 6  | 中国银河证券股份有限公司                     | 46,967.00  | 0.91% |
| 7  | 中信证券股份有限公司                       | 46,743.00  | 0.91% |
| 8  | 海富通基金-工商银行-海富通-东方证券 2 号一对一资产管理计划 | 42,100.00  | 0.82% |
| 9  | 方正证券股份有限公司                       | 16,770.00  | 0.33% |
| 10 | 崔月英                              | 10,000.00  | 0.19% |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 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 | 1,400.00   | 0.0273%  |

### 9.4 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                             | 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 | 0~10               |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                  |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                |                   |
|--------------------------------|-------------------|
| 基金合同生效日(2019 年 11 月 7 日)基金份额总额 | 10,978,628,537.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 5,506,285.00      |
| 本报告期基金总申购份额                    | 50,000.00         |

|               |              |
|---------------|--------------|
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 420,000.00   |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -            |
| 本报告期期末基金份额总额  | 5,136,285.00 |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

2021 年 7 月 7 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第六届董事会第三十六次临时会议审议通过，王智慧先生不再担任公司副总经理职务。

自 2021 年 10 月 27 日起，刘波先生不再担任本基金托管人招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 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。本年度应支付的审计费用是 55,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 2 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

报告期内，上海证监局对我公司进行检查，对公司出具了责令改正的行政监管措施，并对存在问题负有责任的时任副总经理王智慧采取了出具警示函的监管措施。我公司高度重视，已按法律法规和监管要求及时进行了整改，并已提交了整改报告。

报告期内，本基金的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。



## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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 |    |
| 海通证券 | 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。

### 11.7.2 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 |
| 海通证券 | 2,883,210.00 | 100.00%      | 394,000,000.00 | 100.00%      | -    | -            |

## 11.8 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  | 海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金第四次分红公告    | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-18 |
| 2  | 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 | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金       | 2021-03-30 |

|   |                                    |                            |            |
|---|------------------------------------|----------------------------|------------|
|   | 号—指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告             | 电子披露网站                     |            |
| 3 | 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第五次分红公告 | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-05-14 |
| 4 | 海富通基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告        | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-07-07 |
| 5 | 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第六次分红公告 | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-08-24 |
| 6 | 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第七次分红公告 | 证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-11-15 |

## 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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              | 2021/1/1-2021/12/31    | 2,605,147.00 | -    | -          | 2,605,147.00 | 50.72% |
|  | 2              | 2021/1/1-2021/12/15    | 1,200,000.00 | -    | 400,000.00 | 800,000.00   | 15.58% |
| 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> <p>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；</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>4、其他可能的风险。</p> |                |                        |              |      |            |              |        |

注：报告期内单一投资者申购赎回份额包含二级市场交易数据。

## 12.2 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”。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准设立海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金的文件

(二)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基金合同

(三)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招募说明书

(四)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

### 13.2 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。

### 13.3 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

二〇二二年三月三十一日