

**海富通富盈混合型证券投资基金**  
**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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	7
<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	11
<b>§4 管理人报告</b>	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
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	16
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	21
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	21
<b>§5 托管人报告</b>	21
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	21
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	21
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	21
<b>§6 审计报告</b>	21
6.1 审计意见	22
6.2 形成审计意见的基础	22
6.3 其他信息	22
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	22
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	23
<b>§7 年度财务报表</b>	24
7.1 资产负债表	24
7.2 利润表	25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	27
7.4 报表附注	28
<b>§8 投资组合报告</b>	61
8.1 期末基金资产组合情况	61
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	62
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	63
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	73
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 .....	73
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 .....	74
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 .....	74
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 .....	74
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	74
8.12 投资组合报告附注 .....	75
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>76</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	76
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	76
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	77
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>77</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>77</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	77
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 .....	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	78
11.4 基金投资策略的改变 .....	78
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	78
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 .....	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	78
11.8 其他重大事件 .....	79
<b>12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>83</b>
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>84</b>
13.1 备查文件目录 .....	84
13.2 存放地点 .....	85
13.3 查阅方式 .....	85

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通富盈混合型证券投资基金	
基金简称	海富通富盈混合	
基金主代码	009154	
交易代码	009154	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 5 月 20 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	448,575,693.19 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C
下属分级基金的交易代码	009154	009155
报告期末下属分级基金的份 额总额	229,835,745.24 份	218,739,947.95 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过积极主动的管理,追求基金资产的长期稳定回报。
投资策略	本基金以在风险可控下寻求稳定的超额收益作为投资理念,采用稳健的大类资产配置和股票投资策略。本基金通过对宏观经济及证券市场整体走势进行前瞻性研究,同时紧密跟踪资金流向、市场流动性、交易特征和投资者情绪等因素,兼顾经济增长的长期趋势和短期经济周期的波动,结合投资时钟理论,确定基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间的配置比例。并随着各类证券风险收益特征的相对变化,动态调整组合中各类资产的比例,或借助股指期货等金融工具快速灵活地作出反应,以规避或分散市场风险。股票投资方面,本基金将采用量化选股方法构建股票组合,以价值投资作为核心理念,通过量化模型构建多因子 alpha 模型。

	债券投资主要采取利率策略、信用策略、收益率曲线策略以及杠杆策略,力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。另外,本基金投资策略还包括资产支持证券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、股指期货投资策略、流通受限证券投资策略、股票期权投资策略。
业绩比较基准	中债-综合全价(总值)指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率(经汇率调整)×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金,但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票,需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	曾麓燕
	联系电话	021-38650788	021-52629999-212040
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	zengluyan@cib.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95561
传真		021-33830166	021-62535823
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	福建省福州市湖东路154号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层	上海市银城路167号4楼
邮政编码		200120	200041
法定代表人		杨仓兵	陶以平

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网	<a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>

网址	
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（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	海富通基金管理有限公司	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

## §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

3.1.1 期间数据和指标	2021 年		2020 年 5 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C
本期已实现收益	24,542,583.75	37,928,810.04	31,012,737.66	44,204,231.34
本期利润	19,797,959.00	25,183,310.30	48,281,607.41	70,451,257.48
加权平均基金份额本期利润	0.0772	0.0628	0.0522	0.0541
本期加权平均净值利润率	7.12%	5.82%	5.07%	5.00%
本期基金份额净值增长率	6.07%	5.64%	5.53%	5.27%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末	
	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C
期末可供分配利润	27,433,404.65	24,523,070.87	15,361,223.45	18,238,971.28
期末可供分配基金份额利润	0.1194	0.1121	0.0302	0.0277

期末基金资产净值	257,269,149.89	243,263,018.82	536,396,517.73	694,201,792.06
期末基金份额净值	1.1194	1.1121	1.0553	1.0527
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末	
	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C
基金份额累计净值增长率	11.94%	11.21%	5.53%	5.27%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 1. 海富通富盈混合 A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.95%	0.20%	0.41%	0.15%	1.54%	0.05%
过去六个月	3.18%	0.25%	-0.70%	0.20%	3.88%	0.05%
过去一年	6.07%	0.33%	0.24%	0.22%	5.83%	0.11%
自基金合同生效起至今	11.94%	0.28%	3.04%	0.22%	8.90%	0.06%

#### 2. 海富通富盈混合 C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个	1.84%	0.20%	0.41%	0.15%	1.43%	0.05%



月						
过去六个月	2.96%	0.25%	-0.70%	0.20%	3.66%	0.05%
过去一年	5.64%	0.33%	0.24%	0.22%	5.40%	0.11%
自基金合同生效起至今	11.21%	0.28%	3.04%	0.22%	8.17%	0.06%

### 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

海富通富盈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. 海富通富盈混合 A

(2020 年 5 月 20 日至 2021 年 12 月 31 日)



#### 2. 海富通富盈混合 C

(2020 年 5 月 20 日至 2021 年 12 月 31 日)



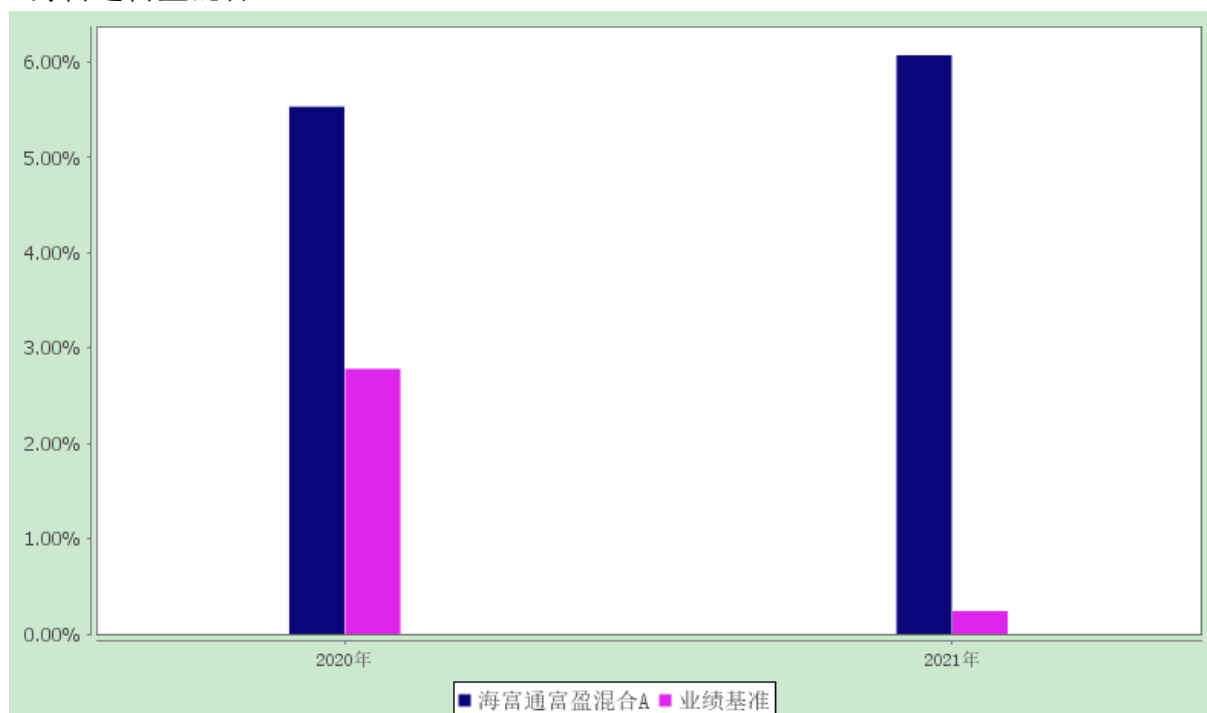
注：本基金合同于2020年5月20日生效。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分(二)投资范围、(四)投资限制中规定的各项比例。

### 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

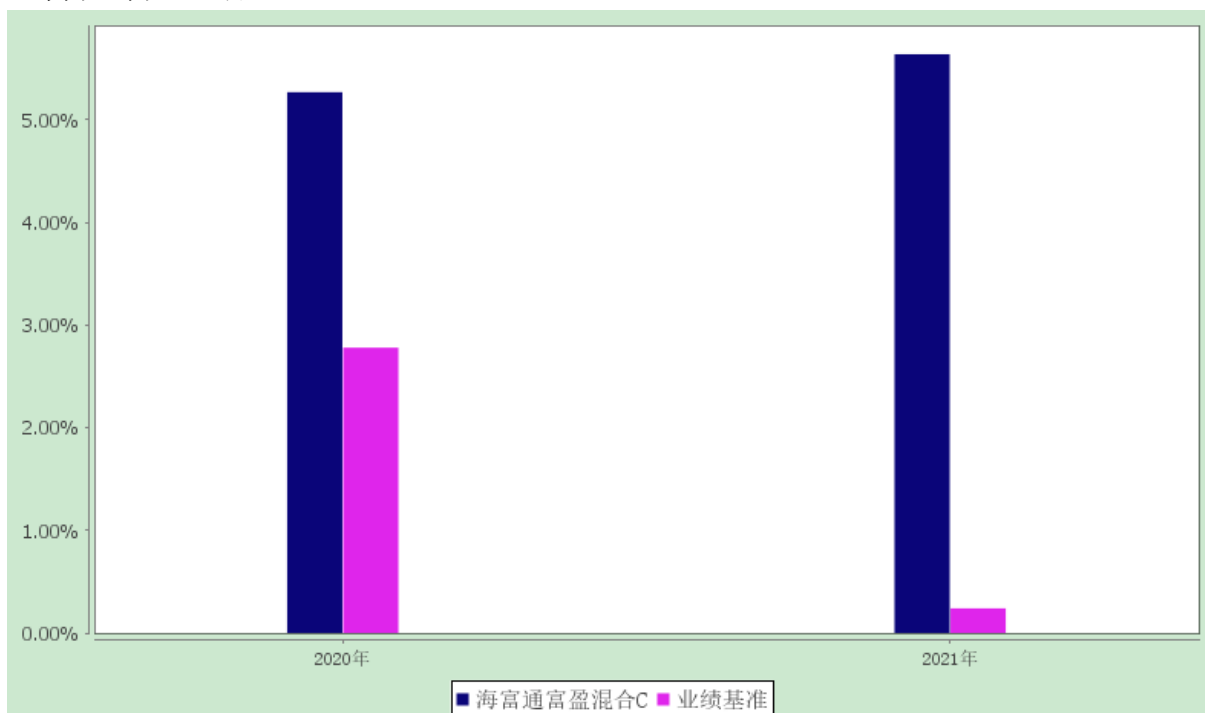
#### 海富通富盈混合型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

#### 1. 海富通富盈混合 A



## 2. 海富通富盈混合 C



注：图中列示的 2020 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 5 月 20 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

## 1、海富通富盈混合 A：

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	-	-	-	-	-
2020 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

## 2、海富通富盈混合 C：

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额	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

	红数				
2021 年	-	-	-	-	-
2020 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金合同于 2020 年 5 月 20 日生效，过去两年未发生利润分配。

## §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		
杜晓海	本基金的基金经理；总经理助理兼量化投资部总监。	2020-05-20	-	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

				<p>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 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 月兼任海富通中证 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 月兼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</p>
--	--	--	--	---

					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混合基金经理。
夏妍妍	本基金的基金经理	2020-05-20	-	7 年	上海交通大学经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任西门子金融服务集团西门子管理培训生，西门子财务租赁有限公司上海分公司高级财务分析师，2014 年加入海富通基金管理有限公司，历任固定收益投资部固定收益分析师、基金经理助理。2018 年 1 月起任海富通欣益混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通一年定期开放债券基金经理。2018 年 4 月至 2021 年 5 月任海富通融丰定开债券基金经理。2019 年 5 月起兼任海富通安颐收益混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通聚合纯债、海富通富祥混合的基金经理。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：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遵规守信情况的说明

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。

#### 4.3.3 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

固定收益部分，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。

信用债方面,2021 年信用债收益率呈现波动下行,整体处于历史 1/5 分位数以下,信用利差整体压缩。城投方面,融资渠道边际收紧,重回疫情前对隐性债务严监管的常态。此外,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;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,虽然 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,2021 年转债市场呈现大牛行情,转债受到了“固收+”资金的大力追捧。在大盘银行转债发行推动下,2021 年可转债市场规模突破 6000 亿大关。同时全年转债市场受到正股和估值双重驱动,整体价格大幅抬升,转债市场绝对价格水平和估值水平都达到历史高位。全年中证转债指数涨幅达 18%。

2021 年,本基金债券部分配置秉承绝对收益的思路,以中高等级信用债为主,适度参与利率债交易。整体来看,获得了稳定较好收益。

权益部分,回顾 2021 年,受益于全球流动性的宽松,整体的风险偏好有所提升。宏观经济逐步下行,需求收缩、供给冲击,但中国疫情控制较好,在全球供应链的分工中有所受益,因此外需贡献了主要支撑力量,带动制造业下半年走高。映射到市场,2021 年市场指数分化较大,以结构性机会为主。大盘蓝筹和港股通跌幅较大,中小盘指数全年有较好的涨幅。具体来看,沪深 300 指数、中证 800、创业板指、中证 1000 和恒生港股通等主要指数当年涨跌幅分别为-5.20%、-0.76%、12.02%、20.52%和-11.06%。

就行业表现而言,31 个申万一级行业表现两极分化尤为显著。全年涨幅居于前五位的行业分别是电力设备、有色金属、煤炭、基础化工和钢铁,全年涨幅在 34%-48%之间。另一边,家用电器、非银金融、房地产、社会服务和食品饮料是跌幅前五的行业,全年跌幅在-6%到-20%之间。全年行情的主线集中在成长和周期两个方向,基本围绕碳中和。

一方面，成长板块中新能源车、光伏、风电、电网设备和新能源运营等板块有明显超额。此外，在传统周期中，受益于全球资源品价格上涨和能源短缺瓶颈的上游原材料、煤炭等板块也有明显超额。而终端消费品板块，一方面下游需求低迷，另一方面受到原材料对毛利率的挤压，总体表现都比较低迷。

从业绩的角度来看，全行业业绩在 2021 年 2 季度业绩增速出现逐季收窄，周期和中游制造板块增收有增利，消费板块的盈利能力出现明显下滑。预计本轮 A 股净利润增速收窄还要延续到 2022 年下半年。

一级市场融资表现比较活跃。随着科创板对公司盈利条件的放松，注册制试点的不断深入，一批高新技术和战略性新兴产业股票发行上市，从万得统计数据来看，全年 A 股市场的权益融资规模，包括 IPO、再融资、优先股、可转债等合计超过 1.8 万亿元，仅次于 2016 年；2021 年的 IPO 数量达到 524 家，处于历史最高水平。截至 2021 年年底，沪深两市的股票数量突破了 4600 支，沪深两市总市值超过 90 万亿元，与 2021 年 GDP 的比值接近 0.8。

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。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通富盈混合 A 净值增长率为 6.07%，同期业绩比较基准收益率为 0.24%，基金净值跑赢业绩比较基准 5.83 个百分点。海富通富盈混合 C 净值增长率为 5.64%，同期业绩比较基准收益率为 0.24%，基金净值跑赢业绩比较基准 5.40 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

固定收益部分，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。

信用债方面，金融防风险已成为政策顶层设计的关键考虑，叠加换届之年有维稳诉

求，预计整体信用风险可控。分行业来看，城投政策仍需在化解长期风险和防范短期系统性风险之间权衡，警惕土地市场热度下降和城投融资弱化共振产生的流动性危机，防范尾部风险；地产行业“政策底”已确立，但行业内部分化或将进一步加剧，关注 1 月到期高峰是否出现超预期风险事件以及房价、金融安全和对地方财政的冲击；在长期碳中和的背景下，叠加供给侧改革、环保安监升级以及疫情扰动等影响，周期品预计维持较好的供需格局，关注中上游高景气行业和中高等级国企产业债机会。

可转债方面，我们认为 2022 年转债市场振幅将加大，指数振幅向历史均值回归是大概率事件，同时高企的转债估值也面临一定压力，转债全年的收益率预期需下调。但行业及个券的结构性机会依旧在，转债依旧是债券市场增强收益的重要来源。

2022 年，本基金债券部分将在控制信用风险的前提下，精选中高等级信用债个券进行配置，并视行情适度参与利率债波段交易，争取获得稳定较高收益。同时，配合股票部分投资策略，做好流动性管理。

权益部分，宏观经济和政策层面，2022 年海外需求可能逐步回落、通胀压力依然较强，美国依旧处于“类滞胀”阶段，美联储缩减购债规模加速、加息预期上升，全球流动性进入收缩周期，美债收益率仍有上行压力。国内一季度经济下行压力快速抬升，PPI 增速延续回落，经济处于“类衰退”阶段，政策空间较大。随着中央经济工作会议定调“稳字当头、稳中求进、政策靠前发力”，预计将是“宽财政+稳货币+宽信用”的组合，社融增速将筑底回升。社融拐点领先于宏观经济拐点，预计 2022 年年中前后经济将触底小幅回升，届时政策宽松程度将减弱。

展望 2022 年，A 股净利润增速及 ROE 将双双下行，盈利驱动阶段结束，进入盈利下行阶段。后续政策实际放松幅度，尤其是宽信用的幅度将决定今年市场估值抬升幅度。一般而言，盈利下行阶段指数以区间震荡为主，市场以结构性机会为主。大方向上，随着上游价格见顶回落、稳增长力度逐步加大，配置逐步向中下游及政策支持方向倾斜。中期来看，偏成长的风格在估值匹配度较好的情况下，仍然是最重要的方向。

#### 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，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。  
本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

#### 4.9 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

本基金本报告期无需要说明的情形。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本托管人依据《海富通富盈混合型证券投资基金基金合同》与《海富通富盈混合型证券投资基金托管协议》，自 2020 年 5 月 20 日起托管海富通富盈混合型证券投资基金（以下称本基金）的全部资产。

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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 2200067 号

海富通富盈混合型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富盈混合型证券投资基金（以下简称“海富通富盈混合基金”）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，公允反映了海富通富盈混合基金 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，我们独立于海富通富盈混合基金，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

海富通富盈混合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富盈混合基金 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富盈混合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,除非海富通富盈混合基金计划进行清算、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富盈混合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,就可能导致对海富通富盈混合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富盈混合基金不能持续经营。

(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。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

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：海富通富盈混合型证券投资基金

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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	7.4.7.1	8,347,718.70	18,140,351.74
结算备付金	7.4.10.6	11,559,258.26	20,020,214.91
存出保证金		2,167,295.31	7,917,409.41
交易性金融资产	7.4.7.2	478,315,843.21	1,344,823,907.23
其中：股票投资		146,443,462.70	338,744,596.47
基金投资		-	-
债券投资		331,872,380.51	1,006,079,310.76
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	-	-
应收证券清算款		561,123.94	4,186,321.87
应收利息	7.4.7.5	5,504,766.45	13,486,656.09
应收股利		-	-
应收申购款		1,582.93	638,301.35



递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		506,457,588.80	1,409,213,162.60
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债:</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	143,000,000.00
应付证券清算款		4,569,296.54	1.72
应付赎回款		452,477.74	33,498,579.21
应付管理人报酬		445,908.59	1,168,944.31
应付托管费		111,477.16	292,236.05
应付销售服务费		90,245.38	262,121.93
应付交易费用	7.4.7.7	51,200.93	192,739.46
应交税费		26,846.72	100,475.58
应付利息		-2,034.25	-50,630.14
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	180,001.28	150,384.69
负债合计		5,925,420.09	178,614,852.81
<b>所有者权益:</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	448,575,693.19	1,167,783,074.29
未分配利润	7.4.7.10	51,956,475.52	62,815,235.50
所有者权益合计		500,532,168.71	1,230,598,309.79
负债和所有者权益总计		506,457,588.80	1,409,213,162.60

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.1194 元，C 类基金份额净值 1.1121 元。基金份额总额 448,575,693.19 份，其中 A 类基金份额 229,835,745.24 份，C 类基金份额 218,739,947.95 份。

## 7.2 利润表

会计主体：海富通富盈混合型证券投资基金

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 5 月 20 日 (基金合同生效 日) 至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>57,888,182.06</b>	<b>143,538,866.69</b>
1.利息收入		17,472,374.33	39,936,786.62
其中：存款利息收入	7.4.7.11	269,537.47	1,234,618.34
债券利息收入		17,062,697.04	36,320,384.52
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		140,139.82	2,381,783.76
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		57,756,120.37	59,321,787.84
其中：股票投资收益	7.4.7.12	68,035,283.68	70,199,838.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,244,296.35	-13,314,664.27
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	-11,243,215.87	-1,833,595.61
股利收益	7.4.7.16	2,208,348.91	4,270,209.17
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-17,490,124.49	43,515,895.89
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	149,811.85	764,396.34
<b>减：二、费用</b>		<b>12,906,912.76</b>	<b>24,806,001.80</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	7,144,012.38	14,495,598.73
2. 托管费	7.4.10.2. 2	1,786,002.96	3,623,899.62
3. 销售服务费		1,742,515.22	3,454,432.50
4. 交易费用	7.4.7.19	762,631.20	1,250,672.73
5. 利息支出		1,180,034.43	1,699,847.58
其中：卖出回购金融资产支出		1,180,034.43	1,699,847.58

6. 税金及附加		54,159.06	103,597.95
7. 其他费用	7.4.7.20	237,557.51	177,952.69
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>44,981,269.30</b>	<b>118,732,864.89</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>44,981,269.30</b>	<b>118,732,864.89</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通富盈混合型证券投资基金

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 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（基金净值）	1,167,783,074.29	62,815,235.50	1,230,598,309.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	44,981,269.30	44,981,269.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-719,207,381.10	-55,840,029.28	-775,047,410.38
其中：1.基金申购款	317,634,182.63	25,956,590.12	343,590,772.75
2.基金赎回款	-1,036,841,563.73	-81,796,619.40	-1,118,638,183.13
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	448,575,693.19	51,956,475.52	500,532,168.71
项目	上年度可比期间 2020 年 5 月 20 日（基金合同生效日）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 (基金净值)	2,931,943,904.52	-	2,931,943,904.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	118,732,864.89	118,732,864.89
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,764,160,830.23	-55,917,629.39	-1,820,078,459.62
其中：1.基金申购款	146,077,669.68	4,683,091.80	150,760,761.48
2.基金赎回款	-1,910,238,499.91	-60,600,721.19	-1,970,839,221.10
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,167,783,074.29	62,815,235.50	1,230,598,309.79

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

海富通富盈混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]332 号《关于准予海富通富盈混合型证券投资基金注册的批复》注册，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通富盈混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,931,336,195.26 元，其中海富通富盈混合 A 为人民币 1,092,228,123.51 元，海富通富盈混合 C 为人民币 1,839,108,071.75 元。经向中国证监会备案，《海富通富盈混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 5 月 20 日正式生效，基金合同生效日的海富通富盈混合 A 基金份额总额为 1,092,446,802.70 份，其中认购资金利息折合 218,679.19 份基金份额，海富通富盈混合 C 基金份额总额为 1,839,497,101.82 份，其中认购资金利息折合 389,030.07 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《海富通富盈混合型证券投资基金基金合同》和《海富通富盈混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通富盈混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、港股通标的股票、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可交换债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、股指期货、股票期权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。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产及存托凭证的比例占基金资产的比例为 0%-40%，投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0-50%，投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%；每个交易日日终，扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金业绩比较基准为：中债-综合全价（总值）指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率（经汇率调整）×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 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。

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具（主要为股指期货投资）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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 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

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益（主要为股指期货投资）按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

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、托管费和销售服务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。

本基金的交易费用于进行股票、债券、资产支持证券、衍生工具（主要为股指期货投资）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《海富通富盈混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金各类份额默认的收益分配方式是现金分红；本基金不同份额类别基金份额，其分红相互独立、互不影响；投资者不同基金交易账户设置的基金分红相互独立、互不影响；若《海富通富盈混合型证券投资基金基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去该类份额每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.14 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股票投资、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：

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

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)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场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 [2014] 81号文《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税 [2016] 127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(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。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	8,347,718.70	18,140,351.74
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	8,347,718.70	18,140,351.74

## 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	120,074,454.93	146,443,462.70	26,369,007.77	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	149,942,415.55	150,214,380.51	271,964.96
	银行间市场	181,948,121.33	181,658,000.00	-290,121.33
	合计	331,890,536.88	331,872,380.51	-18,156.37
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	451,964,991.81	478,315,843.21	26,350,851.40	
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	276,407,346.38	338,744,596.47	62,337,250.09	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	

债券	交易所市场	485,980,000.91	479,324,310.76	-6,655,690.15
	银行间市场	530,894,528.18	526,755,000.00	-4,139,528.18
	合计	1,016,874,529.09	1,006,079,310.76	-10,795,218.33
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,293,281,875.47	1,344,823,907.23	51,542,031.76

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-17,497,080.00	-	-	-
——股指期货	-17,497,080.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-17,497,080.00	-	-	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-56,042,584.13	-	-	-
——股指期货	-56,042,584.13	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-56,042,584.13	-	-	-

1、于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货情况：持有卖出 IF2203 合约市值 -17,822,160.00 元，公允价值变动 -325,080.00 元。

2、按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具——股指期货投资”的期末公

允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

#### 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

本基金于本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 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未持有从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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,116.77	3,168.41
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	79,614.84	40,378.18
应收债券利息	5,424,020.65	13,442,996.09
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	14.19	113.41
合计	5,504,766.45	13,486,656.09

#### 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	50,475.93	186,404.46

银行间市场应付交易费用	725.00	6,335.00
合计	51,200.93	192,739.46

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1.28	384.69
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	180,000.00	150,000.00
合计	180,001.28	150,384.69

#### 7.4.7.9 实收基金

##### 海富通富盈混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 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	508,304,749.87	508,304,749.87
本期申购	144,505,850.76	144,505,850.76
本期赎回（以“-”号填列）	-422,974,855.39	-422,974,855.39
本期末	229,835,745.24	229,835,745.24

##### 海富通富盈混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 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	659,478,324.42	659,478,324.42
本期申购	173,128,331.87	173,128,331.87
本期赎回（以“-”号填列）	-613,866,708.34	-613,866,708.34
本期末	218,739,947.95	218,739,947.95

注：此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

**7.4.7.10 未分配利润****海富通富盈混合 A**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	15,361,223.45	12,730,544.41	28,091,767.86
本期利润	24,542,583.75	-4,744,624.75	19,797,959.00
本期基金份额交易产生的变动数	-10,685,326.46	-9,770,995.75	-20,456,322.21
其中：基金申购款	14,602,328.81	-1,299,505.91	13,302,822.90
基金赎回款	-25,287,655.27	-8,471,489.84	-33,759,145.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,218,480.74	-1,785,076.09	27,433,404.65

**海富通富盈混合 C**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,238,971.28	16,484,496.36	34,723,467.64
本期利润	37,928,810.04	-12,745,499.74	25,183,310.30
本期基金份额交易产生的变动数	-29,963,582.25	-5,420,124.82	-35,383,707.07
其中：基金申购款	8,474,168.60	4,179,598.62	12,653,767.22
基金赎回款	-38,437,750.85	-9,599,723.44	-48,037,474.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,204,199.07	-1,681,128.20	24,523,070.87

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年5月20日（基金合同 生效日）至2020年12月31 日
活期存款利息收入	38,610.84	302,482.83
定期存款利息收入	-	445,472.22



其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	214,906.57	479,906.07
其他	16,020.06	6,757.22
合计	269,537.47	1,234,618.34

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年5月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	335,507,294.03	353,313,074.14
减：卖出股票成本总额	267,472,010.35	283,113,235.59
买卖股票差价收入	68,035,283.68	70,199,838.55

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年5月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	789,024,486.71	1,660,750,621.84
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	777,496,268.08	1,645,011,586.63
减：应收利息总额	12,772,514.98	29,053,699.48
买卖债券差价收入	-1,244,296.35	-13,314,664.27

#### 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

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年5月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股指期货投资收益（税前）	-11,243,215.87	-1,827,224.13
股指期货差价收入应缴纳增值税额	-	-6,371.48
合计	-11,243,215.87	-1,833,595.61

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年5月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,208,348.91	4,270,209.17
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,208,348.91	4,270,209.17

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年5月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1.交易性金融资产	-25,191,180.36	51,542,031.76
——股票投资	-35,968,242.32	62,337,250.09
——债券投资	10,777,061.96	-10,795,218.33
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	7,701,055.87	-8,026,135.87
——权证投资	-	-
——股指期货	7,701,055.87	-8,026,135.87
3.其他	-	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-17,490,124.49	43,515,895.89

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年5月20日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
基金赎回费收入	40,202.59	763,353.10
基金转换费收入	109,609.26	571.47
其他	-	471.77
合计	149,811.85	764,396.34

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年5月20日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	758,631.20	1,228,662.73
银行间市场交易费用	4,000.00	22,010.00
合计	762,631.20	1,250,672.73

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年5月20日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
审计费用	60,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
证券组合费	338.69	108.16
开户费	400.00	-
银行汇划手续费	20,518.82	18,544.53

其他	1,200.00	300.00
账户维护费	35,100.00	9,000.00
合计	237,557.51	177,952.69

#### 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

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

#### 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、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司("兴业银行")	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司("海通证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年5月20日(基金合同生效日)至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	423,202,438.98	100.00%	858,099,693.75	100.00%

### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	306,761.45	100.00%	50,475.93	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2020年5月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	621,216.76	100.00%	186,404.46	100.00%

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

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用海通证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从海通证券获得研究综合服务。

### 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 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年5月20日（基金合 同生效日）至2020年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,144,012.38	14,495,598.73
其中：支付销售机构的客户维护费	2,487,749.42	6,892,080.71

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1.00%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×1.00%/当年天数。

## 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年5月20日（基金合 同生效日）至2020年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,786,002.96	3,623,899.62

注：支付基金托管人兴业银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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×0.25%/当年天数。

## 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通富盈混合A	海富通富盈混合C	合计
兴业银行	-	1,068,124.02	1,068,124.02
海通证券	-	3,192.36	3,192.36
海富通基金	-	637,631.83	637,631.83
合计	-	1,708,948.21	1,708,948.21
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年5月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通富盈混合A	海富通富盈混合C	合计
兴业银行	-	3,243,714.44	3,243,714.44
海通证券	-	7,461.49	7,461.49
海富通基金	-	127,650.31	127,650.31
合计	-	3,378,826.24	3,378,826.24

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：海富通富盈混合 C 类基金日基金销售服务费=前一日 C 类份额对应的基金资产净值 ×0.40%/ 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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 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 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年5月20日(基金合同生效日)至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	8,347,718.70	38,610.84	18,140,351.74	302,482.83

注：本基金通过“兴业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 1,112,827.90 元。（2020 年 12 月 31 日：人民币 20,020,214.91 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

金额单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额

海通证券	688187	时代电气	网下发行	9,764	306,394.32
海通证券	300981	中红医疗	网下发行	6,003	291,685.77
海通证券	688680	海优新材	网下发行	2,795	195,482.30
海通证券	301039	中集车辆	网下发行	20,640	143,654.40
海通证券	601825	沪农商行	网下发行	15,480	137,772.00
海通证券	688626	翔宇医疗	网下发行	3,652	105,250.64
海通证券	688687	凯因科技	网下发行	5,354	101,618.92
海通证券	688630	芯碁微装	网下发行	3,397	51,736.31
海通证券	688665	四方光电	网下发行	1,687	49,817.11
海通证券	688682	霍莱沃	网下发行	946	43,251.12
海通证券	300933	中辰股份	网下发行	11,117	37,464.29
海通证券	688092	爱科科技	网下发行	1,137	21,728.07
海通证券	688217	睿昂基因	网下发行	1,040	19,156.80
海通证券	688038	中科通达	网下发行	2,132	18,335.20
海通证券	688701	卓锦股份	网下发行	2,340	17,503.20
上年度可比期间					
2020年5月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
海通证券	688981	中芯国际	网下发行	462,175	12,691,325.50
海通证券	688180	君实生物	网下发行	29,617	1,643,743.50
海通证券	688521	芯原股份	网下发行	13,200	508,596.00
海通证券	688536	思瑞浦	网下发行	3,566	412,621.86
海通证券	688301	奕瑞科技	网下发行	2,427	290,269.20
海通证券	688550	瑞联新材	网下发行	2,539	288,735.08
海通证券	300879	大叶股份	网下发行	4,660	49,302.80

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于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

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 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

金额单位：人民币元

##### 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票



证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	新股锁定	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	新股锁定	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	新股锁定	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	新股锁定	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股锁定	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股锁定	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	新股锁定	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	新股锁定	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	新股锁定	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	新股锁定	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	新股锁定	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	新股锁定	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	新股锁定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	新股锁定	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	新股锁定	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	新股锁定	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301045	天禄科技	2021-08-06	2022-02-17	新股锁定	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	新股锁定	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-

301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	新股锁定	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	新股锁定	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	新股锁定	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	新股锁定	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	新股锁定	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	新股锁定	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301058	中粮工科	2021-09-01	2022-03-09	新股锁定	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	新股锁定	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301060	兰卫医学	2021-09-06	2022-03-14	新股锁定	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	新股锁定	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	新股锁定	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	新股锁定	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	新股锁定	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	新股锁定	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	新股锁定	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	新股锁定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301081	严牌股份	2021-10-13	2022-04-20	新股锁定	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301082	久盛电气	2021-10-14	2022-04-27	新股锁定	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
301083	百胜智能	2021-10-13	2022-04-21	新股锁定	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301087	可孚医疗	2021-10-15	2022-04-25	新股锁定	93.09	75.34	339	31,557.51	25,540.26	-
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	新股锁定	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润材料	2021-10-19	2022-04-26	新股锁定	10.45	11.22	1,832	19,144.40	20,555.04	-

30109 1	深城 交	2021- 10-20	2022- 04-29	新股 锁定	36.50	31.31	524	19,12 6.00	16,40 6.44	-
30109 2	争光 股份	2021- 10-21	2022- 05-05	新股 锁定	36.31	35.52	323	11,72 8.13	11,47 2.96	-
30109 6	百诚 医药	2021- 12-13	2022- 06-20	新股 锁定	79.60	78.53	170	13,53 2.00	13,35 0.10	-
30110 0	风光 股份	2021- 12-10	2022- 06-17	新股 锁定	27.81	31.14	599	16,65 8.19	18,65 2.86	-
30110 1	明月 镜片	2021- 12-09	2022- 06-16	新股 锁定	26.91	43.36	371	9,983. 61	16,08 6.56	-
30110 8	洁雅 股份	2021- 11-25	2022- 06-06	新股 锁定	57.27	53.71	224	12,82 8.48	12,03 1.04	-
30111 1	粤万 年青	2021- 11-30	2022- 06-07	新股 锁定	10.48	36.68	379	3,971. 92	13,90 1.72	-
30112 6	达嘉 维康	2021- 11-30	2022- 06-07	新股 锁定	12.37	19.23	662	8,188. 94	12,73 0.26	-
30112 7	天源 环保	2021- 12-23	2022- 06-30	新股 锁定	12.03	17.12	1,685	20,27 0.55	28,84 7.20	-
30113 3	金钟 股份	2021- 11-19	2022- 05-26	新股 锁定	14.33	26.95	286	4,098. 38	7,707. 70	-
30113 8	华研 精机	2021- 12-08	2022- 06-15	新股 锁定	26.17	44.86	285	7,458. 45	12,78 5.10	-
30114 9	隆华 新材	2021- 11-03	2022- 05-10	新股 锁定	10.07	16.76	1,214	12,22 4.98	20,34 6.64	-
30115 5	海力 风电	2021- 11-17	2022- 05-24	新股 锁定	60.66	96.75	428	25,96 2.48	41,40 9.00	-
30117 9	泽宇 智能	2021- 12-01	2022- 06-08	新股 锁定	43.99	50.77	295	12,97 7.05	14,97 7.15	-
30118 5	鸥玛 软件	2021- 11-11	2022- 05-19	新股 锁定	11.88	21.16	578	6,866. 64	12,23 0.48	-
30118 8	力诺 特玻	2021- 11-04	2022- 05-11	新股 锁定	13.00	20.48	647	8,411. 00	13,25 0.56	-
30119 0	善水 科技	2021- 12-17	2022- 06-24	新股 锁定	27.85	27.46	575	16,01 3.75	15,78 9.50	-
30119 8	喜悦 智行	2021- 11-25	2022- 06-02	新股 锁定	21.76	29.20	262	5,701. 12	7,650. 40	-
30119 9	迈赫 股份	2021- 11-30	2022- 06-07	新股 锁定	29.28	32.00	402	11,77 0.56	12,86 4.00	-
30121 1	亨迪 药业	2021- 12-14	2022- 06-22	新股 锁定	25.80	33.65	967	24,94 8.60	32,53 9.55	-
60172 8	中国 电信	2021- 08-11	2022- 02-21	新股 锁定	4.53	4.27	394,0 11	1,784, 869.8 3	1,682, 426.9 7	-
68850	正元	2021-	2022-	新股	1.97	6.17	15,43	30,40	95,22	-

9	地信	07-22	02-07	锁定			3	3.01	1.61	
688670	金迪克	2021-07-23	2022-02-07	新股锁定	55.18	74.11	2,310	127,465.80	171,194.10	-
688776	国光电气	2021-08-24	2022-03-01	新股锁定	51.44	184.99	1,447	74,433.68	267,680.53	-
688793	倍轻松	2021-07-07	2022-01-17	新股锁定	27.40	101.73	1,454	39,839.60	147,915.42	-

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算，在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的或询价转让方式受让的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金持有的上市公司非公开发行股份，减持采取集中竞价交易方式或采取大宗交易方式的根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由法规规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

#### 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

本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金，为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计及风险管理委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理政策。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部和督察稽核部及相关业务部门风险管理责任人构成的三层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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 60.06%（2020 年 12 月 31 日：72.11%）。

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 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	69,747,000.00
合计	-	69,747,000.00

注：未评级部分为国债、政策性金融债。

#### 7.4.13.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	146,293,000.00
合计	-	146,293,000.00

#### 7.4.13.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	250,628,810.00	672,486,643.91
AAA 以下	50,014,358.91	68,603,666.85
未评级	31,229,211.60	48,949,000.00
合计	331,872,380.51	790,039,310.76

注：未评级部分为国债、政策性金融债。

#### 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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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股票不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 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上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.63%。

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。

本基金持有及承担的大部分权益类金融资产和金融负债不计息，该部分的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种存在相应的利率风险，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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	8,347,718.70	-	-	-	8,347,718.70
结算备付金	11,559,258.26	-	-	-	11,559,258.26
存出保证金	28,636.11	-	-	2,138,659.20	2,167,295.31
交易性金融资产	138,040,557.04	193,831,823.47	-	146,443,462.70	478,315,843.21
应收证券清算款	-	-	-	561,123.94	561,123.94
应收利息	-	-	-	5,504,766.45	5,504,766.45
应收申购款	-	-	-	1,582.93	1,582.93
资产总计	157,976,170.11	193,831,823.47	-	154,649,595.22	506,457,588.80
负债					



应付证券清算款	-	-	-	4,569,296.54	4,569,296.54
应付赎回款	-	-	-	452,477.74	452,477.74
应付管理人报酬	-	-	-	445,908.59	445,908.59
应付托管费	-	-	-	111,477.16	111,477.16
应付销售服务费	-	-	-	90,245.38	90,245.38
应付交易费用	-	-	-	51,200.93	51,200.93
应交税费	-	-	-	26,846.72	26,846.72
应付利息	-	-	-	-2,034.25	-2,034.25
其他负债	-	-	-	180,001.28	180,001.28
负债总计	-	-	-	5,925,420.09	5,925,420.09
利率敏感度缺口	157,976,170.11	193,831,823.47	-	148,724,175.13	500,532,168.71
<b>上年度末</b> <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	18,140,351.74	-	-	-	18,140,351.74
结算备付金	20,020,214.91	-	-	-	20,020,214.91
存出保证金	7,917,409.41	-	-	-	7,917,409.41
交易性金融资产	328,901,440.00	632,204,423.47	44,973,447.29	338,744,596.47	1,344,823,907.23
应收证券清算款	-	-	-	4,186,321.87	4,186,321.87
应收利息	-	-	-	13,486,656.09	13,486,656.09
应收申购款	-	-	-	638,301.35	638,301.35
资产总计	374,979,416.06	632,204,423.47	44,973,447.29	357,055,875.78	1,409,213,162.60
负债					
卖出回购金融资产款	143,000,000.00	-	-	-	143,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	1.72	1.72
应付赎回款	-	-	-	33,498,579.21	33,498,579.21
应付管理人报酬	-	-	-	1,168,944.31	1,168,944.31
应付托管费	-	-	-	292,236.05	292,236.05
应付交易费用	-	-	-	192,739.46	192,739.46
应付销售服务费	-	-	-	262,121.93	262,121.93
应付利息	-	-	-	-50,630.14	-50,630.14
应交税费	-	-	-	100,475.58	100,475.58
其他负债	-	-	-	150,384.69	150,384.69
负债总计	143,000,000.00	-	-	35,614,852.81	178,614,852.81
利率敏感度缺口	231,979,416.06	632,204,423.47	44,973,447.29	321,441,022.97	1,230,598,309.79

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

#### 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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-1,606,744.73	-4,618,379.30
	市场利率下降 25 个基点	1,629,493.47	4,670,530.59

#### 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	1,650,317.42	1,650,317.42
资产合计	-	1,650,317.42	1,650,317.42
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞口净额	-	1,650,317.42	1,650,317.42
项目	上年度末 2020年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			

交易性金融资产	-	4,067,275.80	4,067,275.80
资产合计	-	4,067,275.80	4,067,275.80
以外币计价的负债			
应付证券清算款	-	1.72	1.72
负债合计	-	1.72	1.72
资产负债表外汇风险敞口净额	-	4,067,274.08	4,067,274.08

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	82,515.87	203,363.70
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-82,515.87	-203,363.70	

#### 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的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2021年12月31日		2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	146,443,462.70	29.26	338,744,596.47	27.53
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	146,443,462.70	29.26	338,744,596.47	27.53

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	6,893,527.94	14,129,083.62
	2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-6,893,527.94	-14,129,083.62

#### 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一层次的余额为人民币 152,960,672.81 元, 第二层次的余额为人民币 325,355,170.40 元, 无属于第三层次的余额(2020 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一层次的余额为人民币

303,772,156.18 元，第二层次的余额为人民币 1,041,051,751.05 元，无属于第三层次的余额）。

(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应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，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 (%)
1	权益投资	146,443,462.70	28.92
	其中：股票	146,443,462.70	28.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	331,872,380.51	65.53

	其中：债券	331,872,380.51	65.53
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	19,906,976.96	3.93
8	其他各项资产	8,234,768.63	1.63
9	合计	506,457,588.80	100.00

注：本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 1,603,518.00 元，占资产净值比例为 0.32%；通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 46,799.42 元，占资产净值比例为 0.01%。

## 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

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	391,941.60	0.08
B	采矿业	3,328,060.00	0.66
C	制造业	104,865,695.07	20.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,597,259.00	0.72
E	建筑业	141,726.00	0.03
F	批发和零售业	1,252,268.94	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	73,872.00	0.01
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,742,810.94	1.15
J	金融业	15,879,515.28	3.17
K	房地产业	2,962,606.50	0.59
L	租赁和商务服务业	1,687,249.00	0.34
M	科学研究和技术服务业	1,749,790.11	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	590,135.91	0.12

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	649,302.62	0.13
R	文化、体育和娱乐业	1,876,304.31	0.37
S	综合	-	-
	合计	144,793,145.28	28.93

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	46,799.42	0.01
金融	457,038.40	0.09
信息技术	488,769.46	0.10
通信服务	657,710.14	0.13
合计	1,650,317.42	0.33

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	2,700	5,535,000.00	1.11
2	002142	宁波银行	127,930	4,897,160.40	0.98
3	600036	招商银行	98,000	4,773,580.00	0.95
4	300059	东方财富	124,920	4,635,781.20	0.93
5	600887	伊利股份	79,000	3,275,340.00	0.65
6	000858	五粮液	13,700	3,050,442.00	0.61
7	600900	长江电力	131,800	2,991,860.00	0.60
8	600309	万华化学	29,415	2,970,915.00	0.59
9	600690	海尔智家	92,400	2,761,836.00	0.55
10	300014	亿纬锂能	23,117	2,731,967.06	0.55
11	600741	华域汽车	94,600	2,677,180.00	0.53
12	601012	隆基股份	30,050	2,590,310.00	0.52
13	000333	美的集团	34,000	2,509,540.00	0.50
14	002271	东方雨虹	47,600	2,507,568.00	0.50
15	000568	泸州老窖	8,800	2,234,056.00	0.45
16	002475	立讯精密	44,318	2,180,445.60	0.44
17	002415	海康威视	40,000	2,092,800.00	0.42

18	600438	通威股份	46,000	2,068,160.00	0.41
19	300316	晶盛机电	28,507	1,981,236.50	0.40
20	300760	迈瑞医疗	5,100	1,942,080.00	0.39
21	300122	智飞生物	15,000	1,869,000.00	0.37
22	000733	振华科技	15,000	1,864,200.00	0.37
23	600406	国电南瑞	45,360	1,815,760.80	0.36
24	000739	普洛药业	50,000	1,754,500.00	0.35
25	000338	潍柴动力	98,000	1,753,220.00	0.35
26	300408	三环集团	37,800	1,685,880.00	0.34
27	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.34
28	601888	中国中免	6,500	1,426,165.00	0.28
29	600276	恒瑞医药	27,240	1,381,340.40	0.28
30	603501	韦尔股份	4,200	1,305,234.00	0.26
31	600048	保利发展	83,200	1,300,416.00	0.26
32	600031	三一重工	55,300	1,260,840.00	0.25
33	601225	陕西煤业	103,000	1,256,600.00	0.25
34	002709	天赐材料	10,500	1,203,825.00	0.24
35	300413	芒果超媒	20,600	1,178,732.00	0.24
36	000661	长春高新	4,000	1,085,600.00	0.22
37	002311	海大集团	14,200	1,040,860.00	0.21
38	601966	玲珑轮胎	27,942	1,021,280.10	0.20
39	002493	荣盛石化	55,800	1,013,328.00	0.20
40	601877	正泰电器	18,500	996,965.00	0.20
41	600111	北方稀土	21,600	989,280.00	0.20
42	002968	新大正	27,550	976,096.50	0.20
43	600884	杉杉股份	29,000	950,330.00	0.19
44	688303	大全能源	14,864	920,973.44	0.18
45	600989	宝丰能源	53,000	920,080.00	0.18
46	603259	药明康德	7,308	866,582.64	0.17
47	601088	中国神华	38,200	860,264.00	0.17
48	688680	海优新材	2,795	853,313.50	0.17
49	000513	丽珠集团	21,000	844,410.00	0.17
50	603986	兆易创新	4,800	844,080.00	0.17
51	002791	坚朗五金	4,500	817,155.00	0.16
52	601899	紫金矿业	78,800	764,360.00	0.15
53	600486	扬农化工	5,600	734,720.00	0.15
54	600885	宏发股份	9,800	731,472.00	0.15
55	300782	卓胜微	2,100	686,280.00	0.14
56	601677	明泰铝业	15,000	661,350.00	0.13
57	000681	视觉中国	27,600	659,640.00	0.13
58	002258	利尔化学	19,400	654,362.00	0.13
59	600570	恒生电子	9,940	617,771.00	0.12
60	002318	久立特材	34,100	609,708.00	0.12
61	603799	华友钴业	5,400	595,674.00	0.12



62	600521	华海药业	27,340	592,184.40	0.12
63	601615	明阳智能	22,300	582,030.00	0.12
64	603218	日月股份	17,451	575,010.45	0.11
65	002460	赣锋锂业	4,000	571,400.00	0.11
66	000963	华东医药	13,900	558,780.00	0.11
67	688660	电气风电	46,934	556,167.90	0.11
68	300659	中孚信息	12,000	544,200.00	0.11
69	002241	歌尔股份	10,000	541,000.00	0.11
70	002727	一心堂	14,000	539,140.00	0.11
71	601688	华泰证券	30,000	532,800.00	0.11
72	300655	晶瑞电材	12,500	522,250.00	0.10
73	301155	海力风电	4,271	514,866.60	0.10
74	001979	招商蛇口	38,100	508,254.00	0.10
75	688036	传音控股	3,210	503,649.00	0.10
76	000776	广发证券	20,000	491,800.00	0.10
77	000786	北新建材	13,700	490,871.00	0.10
78	688131	皓元医药	1,955	486,169.40	0.10
79	00700	腾讯控股	1,300	485,523.58	0.10
80	688089	嘉必优	7,500	460,800.00	0.09
81	03908	中金公司	26,000	457,038.40	0.09
82	002158	汉钟精机	16,800	447,384.00	0.09
83	600426	华鲁恒升	13,780	431,314.00	0.09
84	000538	云南白药	3,900	408,135.00	0.08
85	000063	中兴通讯	11,500	385,250.00	0.08
86	002831	裕同科技	11,400	384,066.00	0.08
87	600219	南山铝业	80,000	376,800.00	0.08
88	600399	抚顺特钢	15,200	376,504.00	0.08
89	300502	新易盛	9,600	376,128.00	0.08
90	600803	新奥股份	20,000	367,200.00	0.07
91	002444	巨星科技	12,000	366,120.00	0.07
92	300750	宁德时代	600	352,800.00	0.07
93	300114	中航电测	19,800	350,064.00	0.07
94	000001	平安银行	21,000	346,080.00	0.07
95	603129	春风动力	1,900	328,700.00	0.07
96	002402	和而泰	11,800	323,674.00	0.06
97	603882	金城医学	2,900	322,973.00	0.06
98	600487	亨通光电	20,600	311,472.00	0.06
99	601222	林洋能源	24,500	297,185.00	0.06
100	002028	思源电气	6,000	295,260.00	0.06
101	600176	中国巨石	15,883	289,070.60	0.06
102	002466	天齐锂业	2,700	288,900.00	0.06
103	300761	立华股份	7,600	287,356.00	0.06
104	601799	星宇股份	1,400	285,950.00	0.06
105	603568	伟明环保	7,700	281,281.00	0.06

106	000830	鲁西化工	18,100	276,206.00	0.06
107	300244	迪安诊断	8,200	275,274.00	0.05
108	300383	光环新网	18,300	271,572.00	0.05
109	300639	凯普生物	9,135	269,573.85	0.05
110	688776	国光电气	1,447	267,680.53	0.05
111	002643	万润股份	11,300	267,132.00	0.05
112	00981	中芯国际	17,500	266,987.28	0.05
113	000519	中兵红箭	10,000	266,700.00	0.05
114	002056	横店东磁	14,100	266,067.00	0.05
115	002595	豪迈科技	9,400	260,944.00	0.05
116	002332	仙琚制药	19,538	257,901.60	0.05
117	002484	江海股份	9,100	248,612.00	0.05
118	603517	绝味食品	3,600	245,988.00	0.05
119	300677	英科医疗	4,200	242,928.00	0.05
120	688276	百克生物	3,486	239,139.60	0.05
121	600821	金开新能	25,100	238,199.00	0.05
122	600563	法拉电子	1,000	232,400.00	0.05
123	02382	舜宇光学科技	1,100	221,782.18	0.04
124	603279	景津装备	4,700	217,986.00	0.04
125	600711	盛屯矿业	20,000	214,600.00	0.04
126	002119	康强电子	14,700	211,974.00	0.04
127	600183	生益科技	9,000	211,950.00	0.04
128	603899	晨光文具	3,200	206,432.00	0.04
129	002645	华宏科技	8,400	204,960.00	0.04
130	603538	美诺华	5,700	202,407.00	0.04
131	002812	恩捷股份	800	200,320.00	0.04
132	002027	分众传媒	24,000	196,560.00	0.04
133	603659	璞泰来	1,200	192,732.00	0.04
134	002463	沪电股份	11,400	189,012.00	0.04
135	000887	中鼎股份	8,600	187,566.00	0.04
136	002008	大族激光	3,400	183,600.00	0.04
137	002139	拓邦股份	9,800	183,162.00	0.04
138	601238	广汽集团	12,000	182,280.00	0.04
139	605358	立昂微	1,500	180,015.00	0.04
140	002539	云图控股	13,500	179,145.00	0.04
141	000002	万 科 A	9,000	177,840.00	0.04
142	002541	鸿路钢构	3,300	176,682.00	0.04
143	000902	新洋丰	10,400	175,656.00	0.04
144	002557	洽洽食品	2,858	175,366.88	0.04
145	300274	阳光电源	1,200	174,960.00	0.03
146	300073	当升科技	2,000	173,740.00	0.03
147	300566	激智科技	6,100	173,362.00	0.03
148	00941	中国移动	4,500	172,186.56	0.03
149	688670	金迪克	2,310	171,194.10	0.03

150	600496	精工钢构	40,000	170,400.00	0.03
151	600745	闻泰科技	1,300	168,090.00	0.03
152	600132	重庆啤酒	1,100	166,452.00	0.03
153	603666	亿嘉和	2,200	165,264.00	0.03
154	603855	华荣股份	6,400	161,792.00	0.03
155	301179	泽宇智能	2,941	161,592.01	0.03
156	002202	金风科技	9,800	161,406.00	0.03
157	002984	森麒麟	4,500	160,065.00	0.03
158	300124	汇川技术	2,300	157,780.00	0.03
159	002223	鱼跃医疗	4,000	151,200.00	0.03
160	600845	宝信软件	2,470	150,250.10	0.03
161	002497	雅化集团	5,200	149,032.00	0.03
162	688793	倍轻松	1,454	147,915.42	0.03
163	600196	复星医药	3,000	146,820.00	0.03
164	603806	福斯特	1,100	143,605.00	0.03
165	300628	亿联网络	1,700	138,465.00	0.03
166	000708	中信特钢	6,500	133,120.00	0.03
167	603187	海容冷链	2,800	132,860.00	0.03
168	601965	中国汽研	7,100	132,131.00	0.03
169	002080	中材科技	3,800	129,276.00	0.03
170	603678	火炬电子	1,700	128,605.00	0.03
171	601636	旗滨集团	7,500	128,250.00	0.03
172	300776	帝尔激光	500	127,950.00	0.03
173	000932	华菱钢铁	24,000	122,640.00	0.02
174	603181	皇马科技	6,380	122,368.40	0.02
175	603995	甬金股份	2,100	121,506.00	0.02
176	300470	中密控股	2,700	120,609.00	0.02
177	603369	今世缘	2,200	119,680.00	0.02
178	603599	广信股份	3,000	117,000.00	0.02
179	600085	同仁堂	2,600	116,948.00	0.02
180	002438	江苏神通	5,600	114,856.00	0.02
181	002262	恩华药业	7,300	114,245.00	0.02
182	603566	普莱柯	5,100	112,710.00	0.02
183	600507	方大特钢	14,200	110,760.00	0.02
184	600298	安琪酵母	1,800	108,648.00	0.02
185	002043	兔宝宝	8,900	107,512.00	0.02
186	601808	中海油服	7,100	106,500.00	0.02
187	601100	恒立液压	1,300	106,340.00	0.02
188	600089	特变电工	5,000	105,850.00	0.02
189	603010	万盛股份	4,000	104,720.00	0.02
190	002714	牧原股份	1,960	104,585.60	0.02
191	600161	天坛生物	3,600	104,256.00	0.02
192	300253	卫宁健康	6,200	103,912.00	0.02
193	300638	广和通	1,900	103,550.00	0.02

194	600104	上汽集团	5,000	103,150.00	0.02
195	000657	中钨高新	6,400	102,912.00	0.02
196	000100	TCL 科技	16,600	102,422.00	0.02
197	002245	蔚蓝锂芯	3,700	101,787.00	0.02
198	600131	国网信通	4,600	100,510.00	0.02
199	300806	斯迪克	1,700	100,300.00	0.02
200	002585	双星新材	3,700	100,196.00	0.02
201	002738	中矿资源	1,400	98,504.00	0.02
202	300979	华利集团	1,100	97,955.00	0.02
203	603987	康德莱	4,500	97,785.00	0.02
204	300088	长信科技	7,300	96,944.00	0.02
205	300476	胜宏科技	3,200	96,800.00	0.02
206	000977	浪潮信息	2,700	96,741.00	0.02
207	603309	维力医疗	6,100	96,563.00	0.02
208	600038	中直股份	1,200	96,360.00	0.02
209	600380	健康元	7,500	96,300.00	0.02
210	603186	华正新材	2,300	96,117.00	0.02
211	300737	科顺股份	5,909	96,021.25	0.02
212	601607	上海医药	4,800	95,376.00	0.02
213	688509	正元地信	15,433	95,221.61	0.02
214	300416	苏试试验	2,800	95,060.00	0.02
215	603588	高能环境	5,400	94,878.00	0.02
216	300481	濮阳惠成	3,900	94,107.00	0.02
217	300919	中伟股份	610	92,421.10	0.02
218	002013	中航机电	5,000	90,900.00	0.02
219	300529	健帆生物	1,700	90,610.00	0.02
220	300037	新宙邦	800	90,400.00	0.02
221	688596	正帆科技	3,436	88,820.60	0.02
222	603901	永创智能	5,500	88,550.00	0.02
223	300294	博雅生物	2,300	88,205.00	0.02
224	688526	科前生物	3,154	86,829.62	0.02
225	603690	至纯科技	1,800	86,670.00	0.02
226	002851	麦格米特	2,700	86,454.00	0.02
227	002266	浙富控股	12,100	86,152.00	0.02
228	300193	佳士科技	6,700	85,425.00	0.02
229	300699	光威复材	1,000	84,480.00	0.02
230	603515	欧普照明	4,000	83,040.00	0.02
231	002601	龙佰集团	2,900	82,911.00	0.02
232	688586	江航装备	2,439	82,682.10	0.02
233	688166	博瑞医药	2,232	81,936.72	0.02
234	002859	洁美科技	2,200	81,840.00	0.02
235	002648	卫星化学	2,000	80,060.00	0.02
236	601009	南京银行	8,900	79,744.00	0.02
237	300680	隆盛科技	2,500	78,000.00	0.02

238	600323	瀚蓝环境	3,700	77,626.00	0.02
239	000636	风华高科	2,600	77,480.00	0.02
240	601717	郑煤机	6,600	76,494.00	0.02
241	688109	品茗股份	1,479	75,754.38	0.02
242	601117	中国化学	6,300	75,600.00	0.02
243	601126	四方股份	3,600	75,240.00	0.02
244	300373	扬杰科技	1,100	73,898.00	0.01
245	603128	华贸物流	5,400	73,872.00	0.01
246	002409	雅克科技	900	73,053.00	0.01
247	603956	威派格	4,100	72,980.00	0.01
248	600872	中炬高新	1,900	72,143.00	0.01
249	300866	安克创新	700	71,750.00	0.01
250	300596	利安隆	1,600	71,616.00	0.01
251	601168	西部矿业	5,200	70,772.00	0.01
252	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.01
253	300263	隆华科技	6,800	69,360.00	0.01
254	600702	舍得酒业	300	68,190.00	0.01
255	688330	宏力达	598	67,968.68	0.01
256	002003	伟星股份	5,300	67,946.00	0.01
257	002938	鹏鼎控股	1,600	67,888.00	0.01
258	600110	诺德股份	4,200	66,990.00	0.01
259	603195	公牛集团	400	66,920.00	0.01
260	600171	上海贝岭	2,600	66,716.00	0.01
261	603203	快克股份	1,800	66,366.00	0.01
262	000498	山东路桥	10,700	66,126.00	0.01
263	603260	合盛硅业	500	65,985.00	0.01
264	300911	亿田智能	800	65,536.00	0.01
265	002111	威海广泰	5,300	64,872.00	0.01
266	600057	厦门象屿	7,600	64,524.00	0.01
267	002978	安宁股份	1,300	54,964.00	0.01
268	600030	中信证券	2,000	52,820.00	0.01
269	300525	博思软件	2,240	52,371.20	0.01
270	00826	天工国际	12,000	46,799.42	0.01
271	688066	航天宏图	600	43,620.00	0.01
272	000547	航天发展	2,400	40,080.00	0.01
273	300036	超图软件	1,300	39,065.00	0.01
274	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.01
275	300015	爱尔眼科	778	32,893.84	0.01
276	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.01
277	300894	火星人	628	30,878.76	0.01
278	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.01
279	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.01
280	300226	上海钢联	660	26,829.00	0.01
281	600019	宝钢股份	3,700	26,492.00	0.01

282	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.01
283	301087	可孚医疗	339	25,540.26	0.01
284	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.01
285	600346	恒力石化	1,100	25,267.00	0.01
286	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
287	300571	平治信息	400	23,424.00	0.00
288	600998	九州通	1,567	23,066.24	0.00
289	300785	值得买	300	21,522.00	0.00
290	301090	华润材料	1,832	20,555.04	0.00
291	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
292	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
293	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
294	603583	捷昌驱动	392	19,454.96	0.00
295	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
296	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
297	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
298	001215	千味央厨	295	17,171.95	0.00
299	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
300	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
301	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
302	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
303	002756	永兴材料	100	14,802.00	0.00
304	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
305	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00
306	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
307	301096	百诚医药	170	13,350.10	0.00
308	300747	锐科激光	225	13,299.75	0.00
309	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
310	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
311	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
312	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
313	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
314	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
315	301108	洁雅股份	224	12,031.04	0.00
316	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
317	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
318	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
319	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
320	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
321	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
322	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
323	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
324	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
325	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00

326	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
327	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
328	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
329	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
330	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
331	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
332	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
333	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
334	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
335	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
336	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
337	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
338	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
339	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
340	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
341	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
342	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
343	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
344	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
345	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
346	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
347	600585	海螺水泥	100	4,030.00	0.00
348	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

注：根据景津装备股份有限公司于 2022 年 1 月 13 日发布的《景津装备股份有限公司关于公司证券简称变更实施公告》，自 2022 年 1 月 18 日起，公司的证券简称由“景津环保”变更为“景津装备”，证券代码“603279”保持不变。

## 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	00700	腾讯控股	4,577,767.86	0.37
2	300059	东方财富	3,418,517.00	0.28
3	601318	中国平安	2,779,569.00	0.23
4	601888	中国中免	2,723,817.00	0.22
5	600741	华域汽车	2,566,204.00	0.21
6	601728	中国电信	2,549,814.69	0.21
7	600309	万华化学	2,521,921.00	0.20

8	603986	兆易创新	2,162,181.00	0.18
9	000932	华菱钢铁	1,647,830.74	0.13
10	300408	三环集团	1,577,815.00	0.13
11	002968	新大正	1,521,983.00	0.12
12	300122	智飞生物	1,325,104.00	0.11
13	600884	杉杉股份	1,305,332.00	0.11
14	688235	百济神州	1,202,787.00	0.10
15	000733	振华科技	1,153,500.00	0.09
16	002709	天赐材料	1,065,075.00	0.09
17	600048	保利发展	1,064,394.00	0.09
18	600111	北方稀土	1,042,810.00	0.08
19	603501	韦尔股份	1,004,436.00	0.08
20	601398	工商银行	999,990.00	0.08

注：“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	14,899,713.00	1.21
2	601318	中国平安	13,654,268.00	1.11
3	600519	贵州茅台	11,876,913.91	0.97
4	600031	三一重工	9,112,445.00	0.74
5	600486	扬农化工	8,242,517.00	0.67
6	000568	泸州老窖	7,712,119.00	0.63
7	603218	日月股份	7,448,655.22	0.61
8	601012	隆基股份	6,798,188.00	0.55
9	600030	中信证券	5,770,769.00	0.47
10	000858	五粮液	5,633,910.60	0.46
11	000333	美的集团	5,551,629.05	0.45
12	002332	仙琚制药	5,418,893.00	0.44
13	601966	玲珑轮胎	5,056,624.00	0.41
14	300760	迈瑞医疗	4,955,138.00	0.40
15	002726	龙大美食	4,929,080.48	0.40
16	601088	中国神华	4,928,659.00	0.40
17	002415	海康威视	4,875,313.00	0.40
18	000538	云南白药	4,682,493.50	0.38
19	000661	长春高新	4,549,805.00	0.37
20	002938	鹏鼎控股	4,321,832.00	0.35

注：“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。



### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	111,139,118.90
卖出股票的收入（成交）总额	335,507,294.03

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

### 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	61,911,211.60	12.37
	其中：政策性金融债	31,229,211.60	6.24
4	企业债券	136,691,000.00	27.31
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	120,964,000.00	24.17
7	可转债（可交换债）	12,306,168.91	2.46
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	331,872,380.51	66.30

### 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	163617	20 藏投 01	300,000	30,339,000.00	6.06
2	190202	19 国开 02	300,000	30,012,000.00	6.00
3	2120092	21 徽商银行二级 01	200,000	20,364,000.00	4.07
4	101752014	17 金地 MTN001	200,000	20,260,000.00	4.05
5	101900731	19 豫高管	200,000	20,164,000.00	4.03

		MTN002			
--	--	--------	--	--	--

**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

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2203	IF2203	-12.00	-17,822,160.00	-325,080.00	-
公允价值变动总额合计					-325,080.00
股指期货投资本期收益					-11,243,215.87
股指期货投资本期公允价值变动					7,701,055.87

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。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的。本基金管理人充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。符合既定投资政策及投资目标。。

### 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	2,167,295.31
2	应收证券清算款	561,123.94
3	应收股利	-
4	应收利息	5,504,766.45
5	应收申购款	1,582.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,234,768.63

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132022	20 广版 EB	2,622,950.00	0.52
2	110064	建工转债	1,711,537.00	0.34
3	110068	龙净转债	1,454,050.00	0.29
4	127016	鲁泰转债	1,271,023.60	0.25
5	113532	海环转债	1,213,955.70	0.24
6	113519	长久转债	1,056,735.60	0.21
7	113530	大丰转债	594,600.00	0.12
8	128132	交建转债	435,440.00	0.09
9	123004	铁汉转债	404,781.57	0.08

10	128083	新北转债	352,530.00	0.07
11	110052	贵广转债	329,280.00	0.07
12	113021	中信转债	325,860.00	0.07
13	128124	科华转债	218,660.00	0.04
14	127019	国城转债	215,020.00	0.04
15	113596	城地转债	98,400.00	0.02
16	123111	东财转 3	1,345.44	0.00

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

## 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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
海富通富盈混合 A	2,130	107,904.11	110,981,622.15	48.29%	118,854,123.09	51.71%
海富通富盈混合 C	3,378	64,754.28	93,617,156.64	42.80%	125,122,791.31	57.20%
合计	5,508	81,440.76	204,598,778.79	45.61%	243,976,914.40	54.39%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、C 级比例分母为各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从	海富通富盈混合 A	821,874.21	0.3576%
	海富通富盈混合 C	30.01	0.0000%

业人员持有本基金	合计	821,904.22	0.1832%
----------	----	------------	---------

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	海富通富盈混合 A	50~100
	海富通富盈混合 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通富盈混合 A	50~100
	海富通富盈混合 C	0
	合计	50~100

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通富盈混合 A	海富通富盈混合 C
基金合同生效日（2020 年 5 月 20 日）基金份额总额	1,092,446,802.70	1,839,497,101.82
本报告期期初基金份额总额	508,304,749.87	659,478,324.42
本报告期基金总申购份额	144,505,850.76	173,128,331.87
减：本报告期基金总赎回份额	422,974,855.39	613,866,708.34
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	229,835,745.24	218,739,947.95

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §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。

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 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 60,000.00 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	2	423,202,438.98	100.00%	306,761.45	100.00%	-

注: 1、报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

## 2、(1)交易单元的选择标准

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

## (2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

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

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

## 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	285,079,705.39	100.00%	6,461,200,000.00	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	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-01
2	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加平安银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-05
3	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-19
4	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-19

5	海富通基金管理有限公司关于旗下基金获配天宇股份（300702）非公开发行 A 股的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-20
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海联泰基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-28
7	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-02
8	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-04
9	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国盛证券有限责任公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-26
10	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-16
11	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增甬兴证券有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-18
12	海富通基金管理有限公司关于网上直销平台开通中国工商银行快捷支付业务并开展申购费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-22
13	海富通基金管理有限公司关于调整网上直销金账户业务并实施费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-22
14	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-25
15	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-29
16	海富通基金管理有限公司关于旗下部分	中国证券报、基金管	2021-03-30



	基金新增招商银行招赢通为销售平台的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
17	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-08
18	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京度小满基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-08
19	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增民商基金销售（上海）有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-13
20	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-15
21	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-21
22	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加招商银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-06
23	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-11
24	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增广东顺德农村商业银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-13
25	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加中国人寿保险股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-30
26	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-05
27	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证	2021-07-07

		监会基金电子披露网站	
28	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-07
29	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增南京证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-19
30	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-08-10
31	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华鑫证券有限责任公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-08-13
32	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-09-01
33	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-09-10
34	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加江苏银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-09-17
35	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海利得基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-09-17
36	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海基煜基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-09-28
37	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江海证券有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-10-14
38	海富通基金管理有限公司关于养老金客户通过直销柜台申购旗下公募基金开展费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-11-13

		网站	
39	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加上海利得基金销售有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-11-23

## 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	2021/12/17-2021/12/31	-	90,982,622.15	-	90,982,622.15	20.28%

#### 产品特有风险

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：

- 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；
- 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。
- 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。
- 4、其他可能的风险。

另外，当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

### 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富盈混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通富盈混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通富盈混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通富盈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

### 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