

海富通富利三个月持有期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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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 7 月 20 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
§2 基金简介	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
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	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
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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.....	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.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	20
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.....	20
§5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	20
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
§6 审计报告	21
6.1 审计意见.....	21
6.2 形成审计意见的基础.....	21
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任.....	22
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任.....	22
§7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表.....	23
7.2 利润表.....	25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	26
7.4 报表附注.....	27
§8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况.....	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	55
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.....	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63

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	64
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	64
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	64
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	64
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	64
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
8.12	投资组合报告附注	65
§9	基金份额持有人信息	67
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
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	68
§10	开放式基金份额变动	68
§11	重大事件揭示	68
11.1	基金份额持有人大会决议	68
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	69
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
11.4	基金投资策略的改变	69
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	69
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	69
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	69
11.8	其他重大事件	70
12	影响投资者决策的其他重要信息	72
§13	备查文件目录	74
13.1	备查文件目录	74
13.2	存放地点	74
13.3	查阅方式	74

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	海富通富利三个月持有	
基金主代码	010850	
交易代码	010850	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 7 月 20 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	207,575,568.82 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C
下属分级基金的交易代码	010850	010851
报告期末下属分级基金的份 额总额	89,803,169.67 份	117,772,399.15 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	<p>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。</p> <p>股票投资方面,本基金将采用量化选股策略、风险估测模型——有效控制预期风险、交易成本模型——控制交易成本以保护投资业绩、投资组合的优化及调整、港股通标的股票的投资策略等策略;</p>

	债券投资方面，本基金将采用利率策略、信用策略、收益率曲线策略、杠杆策略等策略。
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	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	姜敏
	联系电话	021-38650788	4006800000
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		40088-40099	95558
传真		021-33830166	010-85230024
注册地址		上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码		200120	100020
法定代表人		杨仓兵	朱鹤新

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
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	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号 前滩中心 42 楼
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 7 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C
本期已实现收益	761,883.26	729,280.80
本期利润	2,401,722.84	2,836,084.75
加权平均基金份额本期利润	0.0212	0.0193
本期加权平均净值利润率	2.11%	1.92%
本期基金份额净值增长率	2.33%	2.14%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	
	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C
期末可供分配利润	716,338.19	723,774.13
期末可供分配基金份额利润	0.0080	0.0061
期末基金资产净值	91,893,617.07	120,295,803.24
期末基金份额净值	1.0233	1.0214
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	
	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C
基金份额累计净值增长率	2.33%	2.14%

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、本基金合同生效日为 2021 年 7 月 20 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

1. 海富通富利三个月持有 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	2.26%	0.18%	0.41%	0.15%	1.85%	0.03%
自基金合同生效起至今	2.33%	0.19%	-0.62%	0.20%	2.95%	-0.01%

2. 海富通富利三个月持有 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
过去三个月	2.15%	0.18%	0.41%	0.15%	1.74%	0.03%
自基金合同生效起至今	2.14%	0.19%	-0.62%	0.20%	2.76%	-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

海富通富利三个月持有期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. 海富通富利三个月持有 A

(2021 年 7 月 20 日至 2021 年 12 月 31 日)



2. 海富通富利三个月持有 C

(2021 年 7 月 20 日至 2021 年 12 月 31 日)

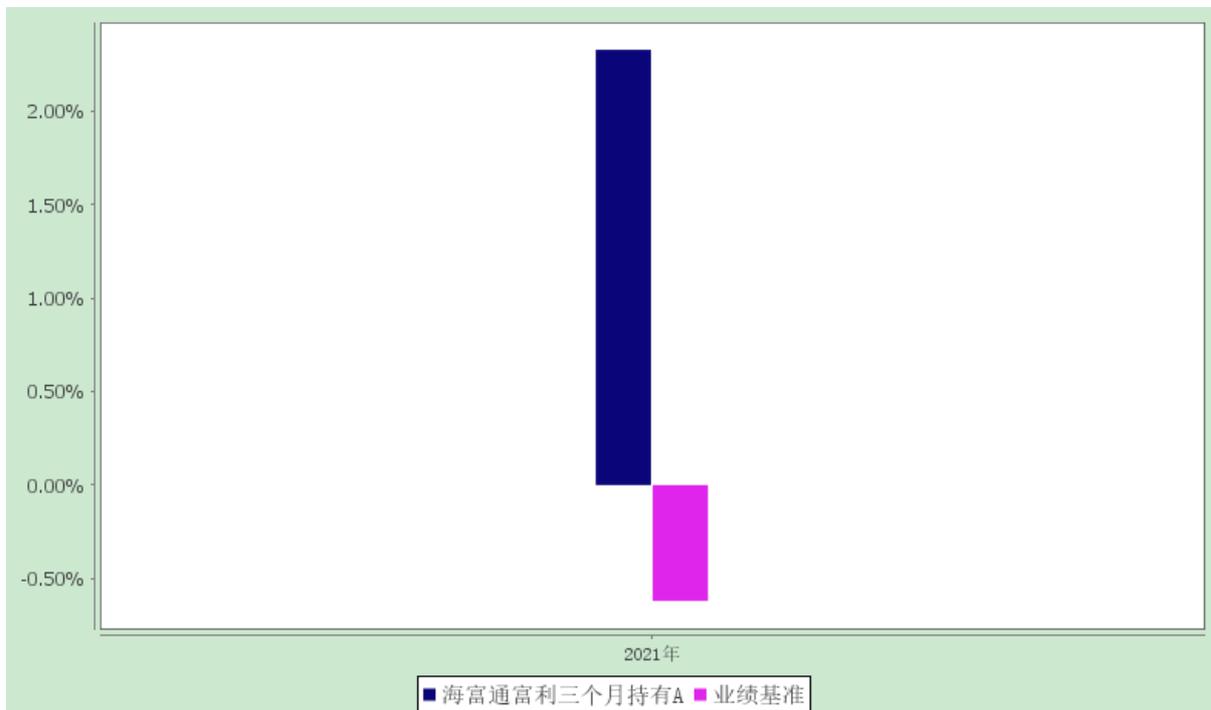


注：1、本基金合同于 2021 年 7 月 20 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。
2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。截止本报告期末，本基金尚处于建仓期。

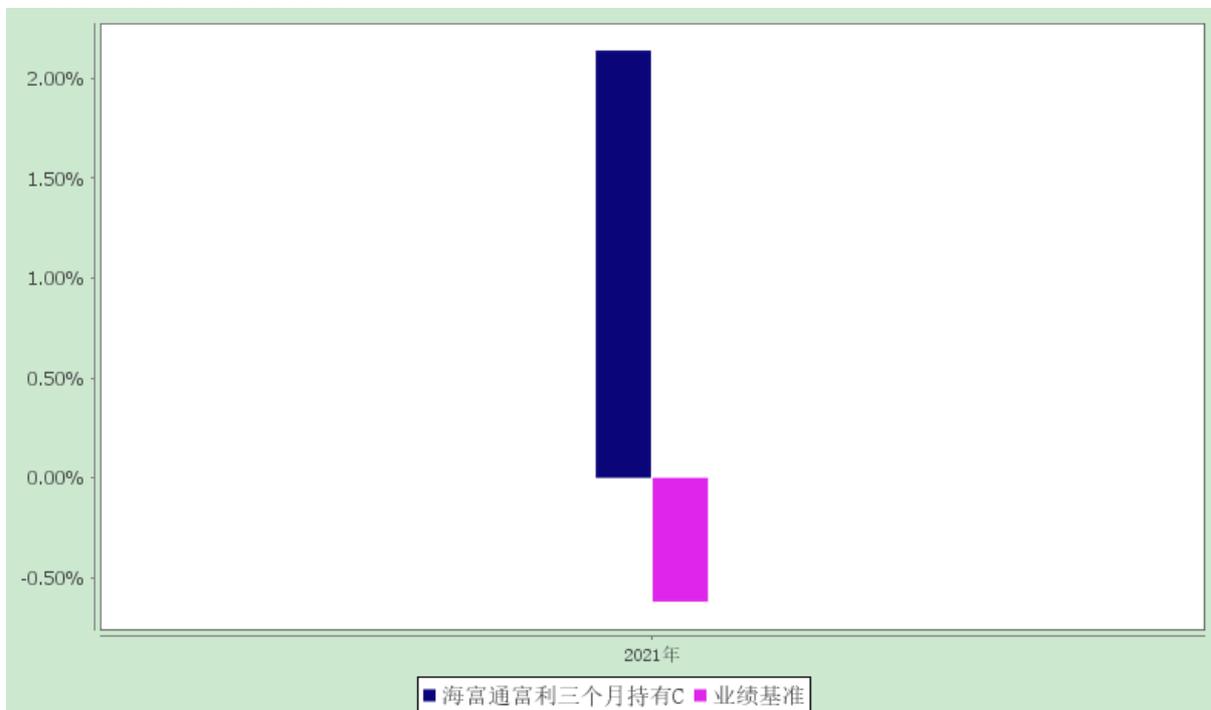
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通富利三个月持有期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. 海富通富利三个月持有 A



2. 海富通富利三个月持有 C



注：图中列示的 2021 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 7 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、海富通富利三个月持有 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	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

2、海富通富利三个月持有 C:

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	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金自基金合同生效日（2021 年 7 月 20 日）至本报告期末未发生利润分配。

§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		
张靖爽	本基金的基金经理；债券基金部副总监。	2021-07-20	-	11 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任中银基金管理有限公司研究员，交银施罗德基金管理有限公司投资经理、基金经理助理、研究员。2016 年 7 月至 2017 年 10 月任海富通双利债券基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 10 月兼任海富通一年定期开放债券基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 11 月兼任海富通纯债债券基金经理。2017 年 8 月起兼任海富通瑞福一年定开债券（现为海富通瑞福债券）和海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2018 年 2 月至 2021 年 2 月任海富通融丰定开债券基金经理。2018 年 11 月至 2020 年 10 月任海富通鼎丰定开债券基金经理。2019 年 5 月起兼任海富通新内需混合基金经理。2019 年 10 月至 2021 年 4 月任海富通聚合纯债基金经理。2019 年 12 月起兼任海富通裕通 30 个月定开债券基金经理。2020 年 4 月起兼任海富通裕昇三年定开债券基金经理。2020 年 5 月至 2021 年 7 月兼任海富通瑞弘 6 个月定开债券基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通

					富泽混合基金经理。2021年7月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。
杜晓海	本基金的基金经理；总经理助理兼量化投资部总监。	2021-07-20	-	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。
--	--	--	--	--	---

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

固定收益方面，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，上半年稳中偏紧，央行公开市场操作缩量回笼。下半年货币政策稳中偏松，并于 7 月与 12 月降准各 50bp，同时通过公开市场操作提供充裕的流动性。

信用环境方面，前三季度社融增速逐渐下滑，四季度针对房企融资的政策出现松动，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。

本组合在 2021 年参与利率债和中高等级信用债的投资，在保持合理流动性的基础上，积极运用中长久期利率债获取收益。

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，海富通富利三个月持有 A 净值增长率为 2.33%，同期业绩比较基准收益率为-0.62%，基金净值跑赢业绩比较基准 2.95 个百分点。海富通富利三个月持有 C 净值增长率为 2.14%，同期业绩比较基准收益率为-0.62%，基金净值跑赢业绩比较基准 2.76 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。

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。

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

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。

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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《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，对海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金 2021 年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何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

本托管人认为，海富通基金管理有限公司在海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本托管人认为，海富通基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2021 年报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2022)第 27899 号

海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金全体基金份额持有人：：

6.1 审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金(以下简称“海富通富利三个月持有混合基金”)的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年 7 月 20 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二) 我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了海富通富利三个月持有混合基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 7 月 20 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间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。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。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于海富通富利三个月持有混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

海富通富利三个月持有混合基金的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”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,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利三个月持有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,除非基金管理人管理层计划清算海富通富利三个月持有混合基金、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利三个月持有混合基金的财务报告过程。

6.4 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:

(一) 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。

(二) 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。

(三) 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。

(四) 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利三个月持有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利三个月持有混合基金不能持续经营。

(五) 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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师
许康玮 朱宏宇
上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：海富通富利三个月持有期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
资产：		-
银行存款	7.4.7.1	647,119.01
结算备付金		23,566,301.40
存出保证金		1,569,245.34
交易性金融资产	7.4.7.2	172,330,255.39
其中：股票投资		77,012,255.39
基金投资		-
债券投资		95,318,000.00
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	14,000,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	965,562.19

应收股利		-
应收申购款		39.96
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		213,078,523.29
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
负 债:		-
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		318,147.03
应付赎回款		200,130.17
应付管理人报酬		149,586.06
应付托管费		28,047.39
应付销售服务费		42,449.06
应付交易费用	7.4.7.7	49,903.09
应交税费		676.00
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	100,164.18
负债合计		889,102.98
所有者权益:		-
实收基金	7.4.7.9	207,575,568.82
未分配利润	7.4.7.10	4,613,851.49
所有者权益合计		212,189,420.31
负债和所有者权益总计		213,078,523.29

注：1、报告截止日 2021 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.0233 元，C 类基金份额净值 1.0214 元。基金份额总额 207,575,568.82 份，其中 A 类基金份额 89,803,169.67 份，C 类基金份额 117,772,399.15 份。

2、基金合同成立于 2021 年 07 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

7.2 利润表

会计主体：海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 7 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2021 年 7 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
一、收入		6,938,347.37
1.利息收入		2,164,426.11
其中：存款利息收入	7.4.7.11	230,589.88
债券利息收入		1,608,411.86
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		325,424.37
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		948,532.76
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,703,062.54
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-105,112.90
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	-778,800.00
股利收益	7.4.7.16	129,383.12
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	3,746,643.53
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	78,744.97
减：二、费用		1,700,539.78
1. 管理人报酬		942,294.07
2. 托管费		176,680.17
3. 销售服务费		265,768.85
4. 交易费用	7.4.7.19	183,451.13
5. 利息支出		23,289.73
其中：卖出回购金融资产支出		23,289.73

6. 税金及附加		378.50
7. 其他费用	7.4.7.20	108,677.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,237,807.59
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,237,807.59

注：本财务报表的实际编制期间为 2021 年 07 月 20 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日，上年度可比期间无比较数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 7 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 7 月 20 日（基金合同生效日）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）	277,641,140.11	-	277,641,140.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,237,807.59	5,237,807.59
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）	-70,065,571.29	-623,956.10	-70,689,527.39
其中：1.基金申购款	55,419,874.24	54,670.40	55,474,544.64
2.基金赎回款	-125,485,445.53	-678,626.50	-126,164,072.03
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）	207,575,568.82	4,613,851.49	212,189,420.31

注：本财务报表的实际编制期间为 2021 年 07 月 20 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月

31 日，上年度可比期间无比较数据。

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

海富通富利三个月持有期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]第 3093 号《关于准予海富通富利三个月持有期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《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金，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 277,601,007.94 元。经向中国证监会备案，《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 7 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 277,641,140.11 份，其中认购资金利息折合 40,132.17 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同》和《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/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/申购基金份额时不收取认/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

本基金对每份基金份额设置三个月的最短持有期。对于每份基金份额，最短持有期起始日指基金合同生效日（对认购份额而言）、基金份额申购申请确认日（对申购份额而言）或基金份额转换转入确认日（对转换转入份额而言）；最短持有期到期日指该基金份额持有期起始日起三个月后的对应日（指某一个特定日期在后续月份中的对应日期），如该对应日为非工作日，则顺延至下一工作日。如无此对应日期，则取该月份的最后一日。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含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、国债期货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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金股票资产及存托凭证投资占基金资产的比例为 0-40% (其中港股通股票投资比例不得超过股票资产的 50%); 本基金投资同业存单不超过基金资产的 20%; 每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金业绩比较基准为: 中债-综合全价(总值)指数收益率 \times 80%+沪深 300 指数收益率 \times 15%+恒生指数收益率(经汇率调整) \times 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

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 7 月 20 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 7 月 20 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 7 月 20 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具(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。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)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；或者(3)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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，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。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应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

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

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。由于申购和赎回引起的实收基金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

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，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。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金

能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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：

(1)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。

(2)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。

(3)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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[2014]81 号《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[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]127 号《财政部国家税务总局证监会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]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通买卖、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。

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

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
	2021 年 12 月 31 日
活期存款	647,119.01
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	647,119.01

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	73,300,470.77	77,012,255.39	3,711,784.62	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	24,146,104.11	24,130,000.00	-16,104.11
	银行间市场	71,030,116.98	71,188,000.00	157,883.02
	合计	95,176,221.09	95,318,000.00	141,778.91
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	168,476,691.86	172,330,255.39	3,853,563.53	

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	-12,764,100.00	-	-	-
——股指期货	-12,764,100.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-12,764,100.00	-	-	-

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 -11,881,440.00 元，公允价值变动-74,640.00 元；卖出 IH2203 合约市值-989,580.00 元，公允价值变动-32,280.00 元；公允价值变动合计-106,920.00 元。

衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0 元。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0 元。

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 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	14,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	14,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

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

应收活期存款利息	102.12
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	11,481.90
应收债券利息	958,964.66
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-4,998.70
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	12.21
合计	965,562.19

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

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
交易所市场应付交易费用	48,185.66
银行间市场应付交易费用	1,717.43
合计	49,903.09

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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	164.18
应付证券出借违约金	-
预提费用	100,000.00
合计	100,164.18

7.4.7.9 实收基金**海富通富利三个月持有 A**

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年7月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	120,616,157.58	120,616,157.58
本期申购	370,765.16	370,765.16
本期赎回（以“-”号填列）	-31,183,753.07	-31,183,753.07
本期末	89,803,169.67	89,803,169.67

海富通富利三个月持有 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年7月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	157,024,982.53	157,024,982.53
本期申购	55,049,109.08	55,049,109.08
本期赎回（以“-”号填列）	-94,301,692.46	-94,301,692.46
本期末	117,772,399.15	117,772,399.15

注：1、本基金自 2021 年 5 月 14 日至 2021 年 7 月 16 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 277,601,007.94 元，折合为 277,601,007.94 份基金份额，其中 A 类基金份额 120,597,199.25 份，C 类基金份额 157,003,808.69 份。根据《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 40,132.17 元在本基金成立后，折合为 40,132.17 份基金份额（其中 A 类基金份额 18,958.33 份，C 类基金份额 21,173.84 份），划入基金份额持有人账户。

2、根据《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同》、《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》、《海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告》相关规定，本基金于 2021 年 7 月 20 日(基金合同生效日)至 2021 年 9 月 2 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购、转换转入、定期定额投资自 2021 年 9 月 3 日起开始办理，赎回、转换转出业务自 2021 年 10 月 20 日起开始办理。

3、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

海富通富利三个月持有 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
本期利润	761,883.26	1,639,839.58	2,401,722.84
本期基金份额交易产生的变动数	-45,545.07	-265,730.37	-311,275.44
其中：基金申购款	521.71	1,581.01	2,102.72
基金赎回款	-46,066.78	-267,311.38	-313,378.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	716,338.19	1,374,109.21	2,090,447.40

海富通富利三个月持有 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
本期利润	729,280.80	2,106,803.95	2,836,084.75
本期基金份额交易产生的变动数	-5,506.67	-307,173.99	-312,680.66
其中：基金申购款	41,183.92	11,383.76	52,567.68
基金赎回款	-46,690.59	-318,557.75	-365,248.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	723,774.13	1,799,629.96	2,523,404.09

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年7月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	39,277.35
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	189,374.20
其他	1,938.33
合计	230,589.88

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年7月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	43,808,005.75
减：卖出股票成本总额	42,104,943.21
买卖股票差价收入	1,703,062.54

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年7月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	111,050,258.55
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	109,352,861.23
减：应收利息总额	1,802,510.22
买卖债券差价收入	-105,112.90

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年7月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股指期货投资收益（税前）	-778,800.00
股指期货差价收入应缴纳增值税额	-
合计	-778,800.00

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年7月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	129,383.12
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	129,383.12

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年7月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1.交易性金融资产	3,853,563.53
——股票投资	3,711,784.62
——债券投资	141,778.91
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-106,920.00
——权证投资	-
——股指期货	-106,920.00
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	3,746,643.53

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年7月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	78,682.99
基金转换费收入	61.98
合计	78,744.97

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年7月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	180,626.13
银行间市场交易费用	2,825.00
合计	183,451.13

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年7月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	40,000.00
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	-
证券组合费	3.80
银行划款手续费	3,673.53
其他费用	100.00
债券托管账户维护费	4,500.00
开户费	400.00
合计	108,677.33

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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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

中信银行股份有限公司(“中信银行”)	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。

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7月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	157,914,993.59	100.00%

注：基金合同成立于 2021 年 7 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易，基金合同成立于 2021 年 7 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

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7月20日（基金合同生效日）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	115,033.82	100.00%	48,185.66	100.00%

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

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

3. 基金合同成立于 2021 年 7 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

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7月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	942,294.07
其中：支付销售机构的客户维护费	281,566.89

注：1. 支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值的 0.8% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.8%/当年天数。

2. 基金合同成立于 2021 年 7 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年7月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	176,680.17

注：1. 支付基金托管人中信银行的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

2. 基金合同成立于 2021 年 7 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

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7月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C	合计
中信银行	-	120,814.17	120,814.17
海通证券	-	964.57	964.57
海富通基金	-	95,501.27	95,501.27

合计	-	217,280.01	217,280.01
----	---	------------	------------

注：1. 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日 C 类份额的基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

2. 基金合同成立于 2021 年 7 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易，基金合同成立于 2021 年 7 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

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

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务，基金合同成立于 2021 年 7 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

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

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务，基金合同成立于 2021 年 7 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

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

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金，基金合同成立于 2021 年 07 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金，基金合同成立于 2021 年 07 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

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7月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中信银行	647,119.01	39,277.35

注：基金合同成立于 2021 年 7 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券，基金合同成立于 2021 年 07 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项，基金合同成立于 2021 年 7 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

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	-
688105	诺唯赞	2021-11-05	2022-05-16	新股锁定	55.00	93.29	1,953	107,415.00	182,195.37	-
688151	华强科技	2021-11-29	2022-06-06	新股锁定	35.09	33.82	3,133	109,936.97	105,958.06	-
688206	概伦电子	2021-12-20	2022-06-28	新股锁定	28.28	33.01	2,720	76,921.60	89,787.20	-
688212	澳华内镜	2021-11-08	2022-05-16	新股锁定	22.50	32.82	3,391	76,297.50	111,292.62	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021-12-27	2022-01-14	老股东配债	100.00	100.00	1,130	113,000.00	113,000.00	-

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

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

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

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、债券型基金，低于股票型基金。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立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 33.60%。基金合同成立于 2021 年 07 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

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
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	13,979,000.00
合计	13,979,000.00

注：未评级部分为国债。基金合同成立于 2021 年 07 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日
AAA	71,289,000.00
AAA 以下	-
未评级	10,050,000.00
合计	81,339,000.00

注：未评级部分为国债。基金合同成立于 2021 年 07 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

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于最短持有期届满后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公司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 0.29%。

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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，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 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	647,119.01	-	-	-	647,119.01
结算备付金	23,566,301.40	-	-	-	23,566,301.40
存出保证金	1,569,245.34	-	-	-	1,569,245.34
交易性金融资产	13,979,000.00	81,226,000.00	113,000.00	77,012,255.39	172,330,255.39
买入返售金融资产	14,000,000.00	-	-	-	14,000,000.00
应收利息	-	-	-	965,562.19	965,562.19
应收申购款	-	-	-	39.96	39.96
资产总计	53,761,665.75	81,226,000.00	113,000.00	77,977,857.54	213,078,523.29
负债					
应付证券清算款	-	-	-	318,147.03	318,147.03
应付赎回款	-	-	-	200,130.17	200,130.17
应付管理人报酬	-	-	-	149,586.06	149,586.06
应付托管费	-	-	-	28,047.39	28,047.39
应付销售服务费	-	-	-	42,449.06	42,449.06
应付交易费用	-	-	-	49,903.09	49,903.09
应交税费	-	-	-	676.00	676.00
其他负债	-	-	-	100,164.18	100,164.18
负债总计	-	-	-	889,102.98	889,102.98
利率敏感度缺口	53,761,665.75	81,226,000.00	113,000.00	77,088,754.56	212,189,420.31

注：1、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。

2、基金合同成立于 2021 年 7 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

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
	市场利率上升 25 个基点	-1,015,847.08
	市场利率下降 25 个基点	1,035,321.41

注：基金合同成立于 2021 年 07 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

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	-	76,282.08	76,282.08
资产合计	-	76,282.08	76,282.08
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	-	76,282.08	76,282.08

注：基金合同成立于 2021 年 07 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

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
1. 所有外币相对人民币升值 5%	3,814.10
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-3,814.10

注：基金合同成立于 2021 年 07 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

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。本基金股票资产及存托凭证投资占基金资产的比例为 0-40%（其中港股通股票投资比例不得超过股票资产的 50%）；本基金投资同业存单不超过基金资产的 20%。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 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	77,012,255.39	36.29
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	77,012,255.39	36.29

注：基金合同成立于 2021 年 7 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

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
	1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	2,531,899.13
	2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-2,531,899.13

注：基金合同成立于 2021 年 07 月 20 日，上年度可比期间无比较数据。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

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 76,517,517.65 元，属于第二层次的余额为 95,812,737.74 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 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。鉴于本基金业务的性质,新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初所有者权益,2021 年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	77,012,255.39	36.14
	其中:股票	77,012,255.39	36.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	95,318,000.00	44.73
	其中:债券	95,318,000.00	44.73
	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	14,000,000.00	6.57
	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	24,213,420.41	11.36
8	其他各项资产	2,534,847.49	1.19
9	合计	213,078,523.29	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 76,282.08 元,占资产净值比例为 0.04%。

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	-	-
B	采矿业	3,547,995.00	1.67
C	制造业	49,571,045.79	23.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,011,966.00	2.36
E	建筑业	563,816.00	0.27
F	批发和零售业	759,248.00	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	1,551,448.00	0.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,090,285.80	0.99
J	金融业	8,486,351.68	4.00
K	房地产业	2,521,904.00	1.19
L	租赁和商务服务业	583,999.00	0.28
M	科学研究和技术服务业	1,299,648.37	0.61
N	水利、环境和公共设施管理业	436,676.00	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	155,918.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	355,671.67	0.17
S	综合	-	-
	合计	76,935,973.31	36.26

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（%）
信息技术	76,282.08	0.04
合计	76,282.08	0.04

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	601288	农业银行	840,900	2,472,246.00	1.17
2	600048	保利发展	148,100	2,314,803.00	1.09
3	600519	贵州茅台	1,100	2,255,000.00	1.06
4	600887	伊利股份	45,800	1,898,868.00	0.89
5	601012	隆基股份	20,400	1,758,480.00	0.83
6	600690	海尔智家	56,900	1,700,741.00	0.80
7	600741	华域汽车	57,200	1,618,760.00	0.76
8	600900	长江电力	69,700	1,582,190.00	0.75
9	600036	招商银行	30,200	1,471,042.00	0.69
10	600438	通威股份	31,400	1,411,744.00	0.67
11	600309	万华化学	13,300	1,343,300.00	0.63
12	600028	中国石化	308,700	1,305,801.00	0.62
13	601398	工商银行	278,100	1,287,603.00	0.61
14	603501	韦尔股份	4,100	1,274,157.00	0.60
15	600461	洪城环境	148,600	1,211,090.00	0.57
16	600803	新奥股份	59,200	1,086,912.00	0.51
17	601006	大秦铁路	167,600	1,072,640.00	0.51
18	600332	白云山	30,200	1,032,840.00	0.49
19	601225	陕西煤业	83,100	1,013,820.00	0.48
20	002142	宁波银行	23,100	884,268.00	0.42
21	600406	国电南瑞	21,900	876,657.00	0.41
22	600884	杉杉股份	26,100	855,297.00	0.40
23	603369	今世缘	14,800	805,120.00	0.38
24	601899	紫金矿业	80,900	784,730.00	0.37
25	600487	亨通光电	51,800	783,216.00	0.37
26	300059	东方财富	18,900	701,379.00	0.33
27	603987	康德莱	32,000	695,360.00	0.33
28	603259	药明康德	5,800	687,764.00	0.32
29	300760	迈瑞医疗	1,800	685,440.00	0.32
30	000858	五粮液	2,900	645,714.00	0.30
31	603678	火炬电子	8,100	612,765.00	0.29
32	600219	南山铝业	122,000	574,620.00	0.27
33	600426	华鲁恒升	18,200	569,660.00	0.27
34	600528	中铁工业	69,200	568,132.00	0.27
35	601238	广汽集团	36,400	552,916.00	0.26
36	601158	重庆水务	85,900	550,619.00	0.26
37	600298	安琪酵母	8,400	507,024.00	0.24

38	600745	闻泰科技	3,900	504,270.00	0.24
39	601688	华泰证券	27,700	491,952.00	0.23
40	002415	海康威视	9,100	476,112.00	0.22
41	603599	广信股份	11,400	444,600.00	0.21
42	002402	和而泰	16,200	444,366.00	0.21
43	601088	中国神华	19,700	443,644.00	0.21
44	600809	山西汾酒	1,400	442,092.00	0.21
45	601888	中国中免	2,000	438,820.00	0.21
46	603181	皇马科技	22,875	438,742.50	0.21
47	600521	华海药业	19,900	431,034.00	0.20
48	600885	宏发股份	5,700	425,448.00	0.20
49	002271	东方雨虹	8,000	421,440.00	0.20
50	603659	璞泰来	2,600	417,586.00	0.20
51	600570	恒生电子	6,700	416,405.00	0.20
52	601877	正泰电器	7,700	414,953.00	0.20
53	601799	星宇股份	2,000	408,500.00	0.19
54	688388	嘉元科技	3,186	400,002.30	0.19
55	601965	中国汽研	20,900	388,949.00	0.18
56	603020	爱普股份	26,200	372,564.00	0.18
57	688526	科前生物	13,484	371,214.52	0.17
58	600183	生益科技	15,200	357,960.00	0.17
59	603799	华友钴业	3,200	352,992.00	0.17
60	600085	同仁堂	7,300	328,354.00	0.15
61	601117	中国化学	27,200	326,400.00	0.15
62	300413	芒果超媒	5,700	326,154.00	0.15
63	600131	国网信通	14,700	321,195.00	0.15
64	300408	三环集团	6,800	303,280.00	0.14
65	000739	普洛药业	8,400	294,756.00	0.14
66	603899	晨光文具	4,500	290,295.00	0.14
67	002585	双星新材	10,700	289,756.00	0.14
68	300073	当升科技	3,300	286,671.00	0.14
69	000776	广发证券	11,600	285,244.00	0.13
70	300014	亿纬锂能	2,400	283,632.00	0.13
71	000568	泸州老窖	1,100	279,257.00	0.13
72	600038	中直股份	3,400	273,020.00	0.13
73	600196	复星医药	5,500	269,170.00	0.13
74	600989	宝丰能源	15,300	265,608.00	0.13
75	603855	华荣股份	10,500	265,440.00	0.13
76	603279	景津环保	5,600	259,728.00	0.12
77	002645	华宏科技	10,400	253,760.00	0.12
78	603707	健友股份	6,000	252,000.00	0.12
79	601677	明泰铝业	5,700	251,313.00	0.12
80	603195	公牛集团	1,500	250,950.00	0.12
81	603995	甬金股份	4,200	243,012.00	0.11

82	600452	涪陵电力	12,000	241,680.00	0.11
83	300481	濮阳惠成	10,000	241,300.00	0.11
84	603128	华贸物流	17,600	240,768.00	0.11
85	300750	宁德时代	400	235,200.00	0.11
86	002475	立讯精密	4,700	231,240.00	0.11
87	600750	江中药业	16,000	231,200.00	0.11
88	002318	久立特材	12,800	228,864.00	0.11
89	600873	梅花生物	29,800	228,566.00	0.11
90	688015	交控科技	6,165	226,872.00	0.11
91	603939	益丰药房	4,100	225,951.00	0.11
92	002001	新 和 成	7,200	224,064.00	0.11
93	603218	日月股份	6,800	224,060.00	0.11
94	600062	华润双鹤	16,500	220,605.00	0.10
95	603901	永创智能	13,600	218,960.00	0.10
96	601607	上海医药	11,000	218,570.00	0.10
97	600110	诺德股份	13,600	216,920.00	0.10
98	603588	高能环境	12,200	214,354.00	0.10
99	601211	国泰君安	11,800	211,102.00	0.10
100	601567	三星医疗	12,900	210,399.00	0.10
101	603606	东方电缆	4,100	209,756.00	0.10
102	688166	博瑞医药	5,690	208,879.90	0.10
103	002541	鸿路钢构	3,900	208,806.00	0.10
104	600886	国投电力	18,100	207,607.00	0.10
105	002444	巨星科技	6,700	204,417.00	0.10
106	603277	银都股份	11,000	203,500.00	0.10
107	601669	中国电建	25,100	202,808.00	0.10
108	002139	拓邦股份	10,800	201,852.00	0.10
109	601838	成都银行	16,700	200,400.00	0.09
110	600216	浙江医药	11,700	199,836.00	0.09
111	601009	南京银行	22,100	198,016.00	0.09
112	603690	至纯科技	4,000	192,600.00	0.09
113	600399	抚顺特钢	7,700	190,729.00	0.09
114	600171	上海贝岭	7,400	189,884.00	0.09
115	600585	海螺水泥	4,700	189,410.00	0.09
116	603883	老百姓	3,800	187,644.00	0.09
117	600323	瀚蓝环境	8,900	186,722.00	0.09
118	603517	绝味食品	2,700	184,491.00	0.09
119	600018	上港集团	33,600	184,128.00	0.09
120	601636	旗滨集团	10,700	182,970.00	0.09
121	688105	诺唯赞	1,953	182,195.37	0.09
122	002643	万润股份	7,600	179,664.00	0.08
123	600276	恒瑞医药	3,500	177,485.00	0.08
124	601615	明阳智能	6,800	177,480.00	0.08
125	002812	恩捷股份	700	175,280.00	0.08

126	600660	福耀玻璃	3,700	174,418.00	0.08
127	601100	恒立液压	2,100	171,780.00	0.08
128	600285	羚锐制药	10,400	164,320.00	0.08
129	000661	长春高新	600	162,840.00	0.08
130	688169	石头科技	200	162,600.00	0.08
131	300122	智飞生物	1,300	161,980.00	0.08
132	002709	天赐材料	1,400	160,510.00	0.08
133	002430	杭氧股份	5,300	159,053.00	0.07
134	603882	金域医学	1,400	155,918.00	0.07
135	600161	天坛生物	5,200	150,592.00	0.07
136	600057	厦门象屿	17,100	145,179.00	0.07
137	600019	宝钢股份	19,300	138,188.00	0.07
138	603666	亿嘉和	1,800	135,216.00	0.06
139	600483	福能股份	8,100	131,868.00	0.06
140	603186	华正新材	3,100	129,549.00	0.06
141	002043	兔宝宝	10,700	129,256.00	0.06
142	600577	精达股份	17,300	128,712.00	0.06
143	002332	仙琚制药	9,700	128,040.00	0.06
144	002727	一心堂	3,300	127,083.00	0.06
145	603566	普莱柯	5,700	125,970.00	0.06
146	603986	兆易创新	700	123,095.00	0.06
147	002080	中材科技	3,600	122,472.00	0.06
148	603309	维力医疗	7,700	121,891.00	0.06
149	603129	春风动力	700	121,100.00	0.06
150	688596	正帆科技	4,606	119,065.10	0.06
151	603010	万盛股份	4,500	117,810.00	0.06
152	002595	豪迈科技	4,200	116,592.00	0.05
153	603816	顾家家居	1,500	115,740.00	0.05
154	000733	振华科技	900	111,852.00	0.05
155	601377	兴业证券	11,300	111,644.00	0.05
156	688212	澳华内镜	3,391	111,292.62	0.05
157	002557	洽洽食品	1,800	110,448.00	0.05
158	688586	江航装备	3,241	109,869.90	0.05
159	002158	汉钟精机	4,100	109,183.00	0.05
160	300566	激智科技	3,800	107,996.00	0.05
161	000786	北新建材	3,000	107,490.00	0.05
162	601689	拓普集团	2,000	106,000.00	0.05
163	688151	华强科技	3,133	105,958.06	0.05
164	601233	桐昆股份	5,000	105,900.00	0.05
165	688066	航天宏图	1,443	104,906.10	0.05
166	000887	中鼎股份	4,800	104,688.00	0.05
167	603203	快克股份	2,800	103,236.00	0.05
168	300476	胜宏科技	3,400	102,850.00	0.05
169	600872	中炬高新	2,700	102,519.00	0.05

170	600958	东方证券	6,900	101,706.00	0.05
171	603886	元祖股份	4,300	101,265.00	0.05
172	601231	环旭电子	6,200	99,572.00	0.05
173	603538	美诺华	2,800	99,428.00	0.05
174	688201	信安世纪	1,570	98,360.50	0.05
175	002223	鱼跃医疗	2,600	98,280.00	0.05
176	601126	四方股份	4,700	98,230.00	0.05
177	000039	中集集团	5,700	97,812.00	0.05
178	300316	晶盛机电	1,400	97,300.00	0.05
179	601717	郑煤机	8,300	96,197.00	0.05
180	300124	汇川技术	1,400	96,040.00	0.05
181	002119	康强电子	6,600	95,172.00	0.04
182	300596	利安隆	2,100	93,996.00	0.04
183	603260	合盛硅业	700	92,379.00	0.04
184	603806	福斯特	700	91,385.00	0.04
185	600845	宝信软件	1,500	91,245.00	0.04
186	600702	舍得酒业	400	90,920.00	0.04
187	600132	重庆啤酒	600	90,792.00	0.04
188	603956	威派格	5,100	90,780.00	0.04
189	300529	健帆生物	1,700	90,610.00	0.04
190	688206	概伦电子	2,720	89,787.20	0.04
191	300628	亿联网络	1,100	89,595.00	0.04
192	688036	传音控股	571	89,589.90	0.04
193	002409	雅克科技	1,100	89,287.00	0.04
194	600346	恒力石化	3,700	84,989.00	0.04
195	603823	百合花	5,700	84,930.00	0.04
196	002968	新大正	2,300	81,489.00	0.04
197	002463	沪电股份	4,900	81,242.00	0.04
198	000069	华侨城 A	11,400	80,256.00	0.04
199	000902	新洋丰	4,700	79,383.00	0.04
200	00981	中芯国际	5,000	76,282.08	0.04
201	002756	永兴材料	500	74,010.00	0.03
202	002791	坚朗五金	400	72,636.00	0.03
203	002202	金风科技	4,400	72,468.00	0.03
204	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.03
205	002497	雅化集团	2,300	65,918.00	0.03
206	002984	森麒麟	1,800	64,026.00	0.03
207	002438	江苏神通	3,000	61,530.00	0.03
208	688033	天宜上佳	1,824	60,283.20	0.03
209	002003	伟星股份	4,600	58,972.00	0.03
210	601966	玲珑轮胎	1,600	58,480.00	0.03
211	002026	山东威达	3,000	55,230.00	0.03
212	603713	密尔克卫	400	53,912.00	0.03
213	002245	蔚蓝锂芯	1,900	52,269.00	0.02

214	002436	兴森科技	3,400	47,600.00	0.02
215	002056	横店东磁	2,500	47,175.00	0.02
216	300253	卫宁健康	2,800	46,928.00	0.02
217	600563	法拉电子	200	46,480.00	0.02
218	001979	招商蛇口	3,400	45,356.00	0.02
219	600050	中国联通	11,400	44,802.00	0.02
220	300638	广和通	800	43,600.00	0.02
221	000657	中钨高新	2,700	43,416.00	0.02
222	002851	麦格米特	1,300	41,626.00	0.02
223	300639	凯普生物	1,400	41,314.00	0.02
224	300806	斯迪克	700	41,300.00	0.02
225	002597	金禾实业	800	41,080.00	0.02
226	300416	苏试试验	1,200	40,740.00	0.02
227	600507	方大特钢	5,200	40,560.00	0.02
228	300088	长信科技	3,000	39,840.00	0.02
229	300502	新易盛	1,000	39,180.00	0.02
230	300294	博雅生物	1,000	38,350.00	0.02
231	300193	佳士科技	3,000	38,250.00	0.02
232	002013	中航机电	2,100	38,178.00	0.02
233	002008	大族激光	700	37,800.00	0.02
234	002831	裕同科技	1,100	37,059.00	0.02
235	002539	云图控股	2,700	35,829.00	0.02
236	002266	浙富控股	5,000	35,600.00	0.02
237	603650	彤程新材	700	35,224.00	0.02
238	000498	山东路桥	5,600	34,608.00	0.02
239	300699	光威复材	400	33,792.00	0.02
240	002859	洁美科技	900	33,480.00	0.02
241	002111	威海广泰	2,700	33,048.00	0.02
242	300630	普利制药	600	33,024.00	0.02
243	000636	风华高科	1,100	32,780.00	0.02
244	000708	中信特钢	1,600	32,768.00	0.02
244	300911	亿田智能	400	32,768.00	0.02
246	002648	卫星化学	800	32,024.00	0.02
247	000792	盐湖股份	900	31,851.00	0.02
248	000012	南玻 A	3,200	31,776.00	0.01
249	300358	楚天科技	1,200	31,284.00	0.01
250	300866	安克创新	300	30,750.00	0.01
251	300263	隆华科技	3,000	30,600.00	0.01
252	002938	鹏鼎控股	700	29,701.00	0.01
253	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.01
254	688330	宏力达	255	28,983.30	0.01
255	601388	怡球资源	6,500	28,925.00	0.01
256	002460	赣锋锂业	200	28,570.00	0.01
257	002738	中矿资源	400	28,144.00	0.01

258	300373	扬杰科技	400	26,872.00	0.01
259	603298	杭叉集团	1,000	17,150.00	0.01
260	001234	泰慕士	333	5,504.49	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601288	农业银行	3,791,607.00	1.79
2	600036	招商银行	3,383,205.00	1.59
3	600519	贵州茅台	3,026,656.00	1.43
4	600887	伊利股份	2,974,606.00	1.40
5	600028	中国石化	2,899,493.00	1.37
6	601012	隆基股份	2,787,296.00	1.31
7	600528	中铁工业	2,393,820.00	1.13
8	600900	长江电力	2,196,923.00	1.04
9	601398	工商银行	2,190,835.00	1.03
10	601225	陕西煤业	2,093,051.00	0.99
11	600309	万华化学	2,076,854.00	0.98
12	601117	中国化学	1,994,192.00	0.94
13	600048	保利发展	1,950,519.00	0.92
14	600690	海尔智家	1,595,715.00	0.75
15	601166	兴业银行	1,594,459.00	0.75
16	601888	中国中免	1,590,248.00	0.75
17	600438	通威股份	1,570,261.00	0.74
18	600741	华域汽车	1,485,694.00	0.70
19	600803	新奥股份	1,426,386.00	0.67
20	600461	洪城环境	1,399,011.00	0.66

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末基金资产净值 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	占期末基金
----	------	------	----------	-------

				资产净值比例 (%)
1	601117	中国化学	2,113,188.00	1.00
2	600036	招商银行	1,952,796.00	0.92
3	600528	中铁工业	1,833,646.00	0.86
4	600028	中国石化	1,699,138.00	0.80
5	601166	兴业银行	1,576,530.00	0.74
6	600887	伊利股份	1,495,077.00	0.70
7	601225	陕西煤业	1,487,714.00	0.70
8	601288	农业银行	1,301,440.00	0.61
9	600519	贵州茅台	1,243,067.00	0.59
10	601158	重庆水务	1,024,976.00	0.48
11	600030	中信证券	1,003,618.00	0.47
12	600900	长江电力	999,931.00	0.47
13	601012	隆基股份	990,833.00	0.47
14	601888	中国中免	903,067.12	0.43
15	600050	中国联通	900,985.00	0.42
16	601398	工商银行	899,418.00	0.42
17	600285	羚锐制药	856,155.00	0.40
18	600380	健康元	806,291.00	0.38
19	002311	海大集团	773,512.67	0.36
20	000858	五粮液	686,280.00	0.32

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	115,405,413.98
卖出股票的收入（成交）总额	43,808,005.75

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	24,029,000.00	11.32
2	央行票据	-	-
3	金融债券	61,138,000.00	28.81
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	10,038,000.00	4.73
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	113,000.00	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	95,318,000.00	44.92

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	2028037	20 光大银行永续债	200,000	20,912,000.00	9.86
2	2128025	21 建设银行二级 01	200,000	20,188,000.00	9.51
3	019658	21 国债 10	140,000	13,979,000.00	6.59
4	210011	21 付息国债 11	100,000	10,050,000.00	4.74
5	2128027	21 招商银行小微债 03	100,000	10,040,000.00	4.73

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

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	风险说明
----	----	-----	------	-------	------

				动	
IF2203	IF2203	-8.00	-11,881,440.00	-74,640.00	-
IH2203	IH2203	-1.00	-989,580.00	-32,280.00	-
公允价值变动总额合计					-106,920.00
股指期货投资本期收益					-778,800.00
股指期货投资本期公允价值变动					-106,920.00

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将根据风险管理的原则，以套期保值为目的。本基金管理人将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。

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

根据风险管理原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

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

本报告期内本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的 20 建设银行二级 01（2128025）的发行人，因占压财政存款或者资金、违反账户管理规定，于 2021 年 8 月 13 日被中国人民银行警告，并处罚款 388 万元。

对该证券的投资决策程序的说明：银行业整体信用水平高，且该银行为全国大型银行，综合实力强，信用风险可控。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

报告期内本基金投资的 21 招商银行小微债 03（2128027）的发行人，因为同业投资提供

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

对该证券的投资决策程序的说明：公司整体信用水平高，为全国大型银行，综合实力强，信用风险可控。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

报告期内本基金投资的 21 民生银行 02（2128048）的发行人，作为银行间债券市场做市商，在开展做市业务时主导开展倒量等虚假交易；作为债务融资工具存续期管理机构，未及时召开“18 乍浦建设 MTN001”持有人会议，持有人会议组织召开不符合规定程序，于 2021 年 7 月 5 日被中国银行间市场交易商协会予以通报批评，并责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。因监管发现问题屡查屡犯、检查发现问题整改不到位、对责任人员的责任认定和问责不到位、内部制度管理不足、配合现场检查不力、信息系统管控有效性不足、未向监管部门真实反映业务数据等违规行为，于 2021 年 7 月 13 日被中国银行保险监督管理委员会处罚罚款 11450 万元。

对该证券的投资决策程序的说明：银行业整体信用水平高，且该银行为全国大型银行，综合实力强，信用风险可控。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

其余七名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	1,569,245.34
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	965,562.19
5	应收申购款	39.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,534,847.49

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
海富通富利三个月持有 A	2,116	42,440.06	20,706,917.66	23.06%	69,096,252.01	76.94%
海富通富利三个月持有 C	664	177,368.07	60,452,965.51	51.33%	57,319,433.64	48.67%
合计	2,780	74,667.47	81,159,883.17	39.10%	126,415,685.65	60.90%

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
基金管理人所有从业人员持有本基金	海富通富利三个月持有 A	210,058.06	0.2339%
	海富通富利三个月持有 C	481,944.78	0.4092%
	合计	692,002.84	0.3334%

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	海富通富利三个月持有 A	10~50
	海富通富利三个月持有 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通富利三个月持有 A	10~50
	海富通富利三个月持有 C	0
	合计	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通富利三个月持有 A	海富通富利三个月持有 C
基金合同生效日（2021 年 7 月 20 日）基金份额总额	120,616,157.58	157,024,982.53
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	370,765.16	55,049,109.08
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	31,183,753.07	94,301,692.46
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	89,803,169.67	117,772,399.15

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。

2021 年 3 月 15 日，本基金托管人中信银行股份有限公司对外公告，李庆萍女士因工作安排原因，辞去中信银行董事长、执行董事及董事会战略发展委员会主席和委员职务。自 2021 年 9 月 2 日起，中信银行法定代表人由李庆萍女士变更为朱鹤新先生。

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

本基金自基金合同生效以来聘请普华永道中天会计师事务所提供审计服务。本年度应支付的审计费用是 40,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 1 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	157,914,993.59	100.00%	115,033.82	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	24,044,237.61	100.00%	1,017,700,000.00	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	海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金份额发售公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-07
2	海富通基金管理有限公司关于海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金 A 类份额参加东方财富证券股份有限公司认购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-12
3	海富通基金管理有限公司关于海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金新增交通银行股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-15
4	海富通基金管理有限公司关于海富通富	证券时报、基金管理	2021-06-16

	利三个月持有期混合型证券投资基金新增销售机构并参加认购费率优惠活动的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
5	海富通基金管理有限公司关于海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金新增销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-01
6	海富通基金管理有限公司关于海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金新增销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-06
7	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-07
8	海富通基金管理有限公司关于海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金新增销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-07
9	海富通基金管理有限公司关于海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金新增销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-10
10	关于海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金提前结束募集的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-12
11	海富通基金管理有限公司关于海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金新增销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-13
12	海富通基金管理有限公司关于海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金新增兴业银行股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-14
13	海富通基金管理有限公司关于海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金新增北京汇成基金销售有限公司为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-14
14	海富通基金管理有限公司关于海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金新增销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-15
15	海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会	2021-07-21

		会基金电子披露网站	
16	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加海通期货股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-23
17	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-08-27
18	海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-08-31
19	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国人寿保险股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-09-27
20	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-09-28
21	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-11-13
22	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-11-23
23	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-11-23
24	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国信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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-12-01

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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

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利三个月持有期混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通富利三个月持有期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