

海富通惠鑫混合型证券投资基金
2022 年第 2 季度报告
2022 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年七月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 7 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 海富通惠鑫混合 |
| 基金主代码 | 013015 |
| 交易代码 | 013015 |
| 基金运作方式 | 契约型、开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 3 月 9 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 46,248,559.73 份 |
| 投资目标 | 本基金通过积极主动的资产配置，在控制风险的前提下，积极把握证券市场的投资机会，力争实现资产的保值增值。 |
| 投资策略 | 本基金为混合型基金，对股票资产及存托凭证的投资比例占基金资产的 10%-50%。在此约束下，本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场风险收益特征及市场行为因素等进行评估分析，对股票资产和固定收益类资产等的预期风险收益进行动态跟踪，从而构建本基金的投资组合。股票投资方面，主要有行业配置策略、个股精选策略、港股通标的股票的投资策略；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存托凭证投资策略、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、国债期货投资策略、股票期权投资策略、流通受限证券投资策略等。 | |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×20%+中证综合债指数收益率×75%+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。 | |
| 基金管理人 | 海富通基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 平安银行股份有限公司 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 海富通惠鑫混合 A | 海富通惠鑫混合 C |
| 下属两级基金的交易代码 | 013015 | 013016 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 7,419,715.97 份 | 38,828,843.76 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 (2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日) | |
|----------------|---|---------------|
| | 海富通惠鑫混合 A | 海富通惠鑫混合 C |
| 1.本期已实现收益 | 27,523.76 | 205,029.71 |
| 2.本期利润 | 40,135.28 | 268,170.16 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0074 | 0.0058 |
| 4.期末基金资产净值 | 7,469,939.51 | 39,071,990.24 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0068 | 1.0063 |

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、海富通惠鑫混合 A：

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.62% | 0.05% | 2.38% | 0.35% | -1.76% | -0.30% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.68% | 0.04% | 2.75% | 0.41% | -2.07% | -0.37% |

2、海富通惠鑫混合 C：

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.58% | 0.05% | 2.38% | 0.35% | -1.80% | -0.30% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.63% | 0.05% | 2.75% | 0.41% | -2.12% | -0.36% |

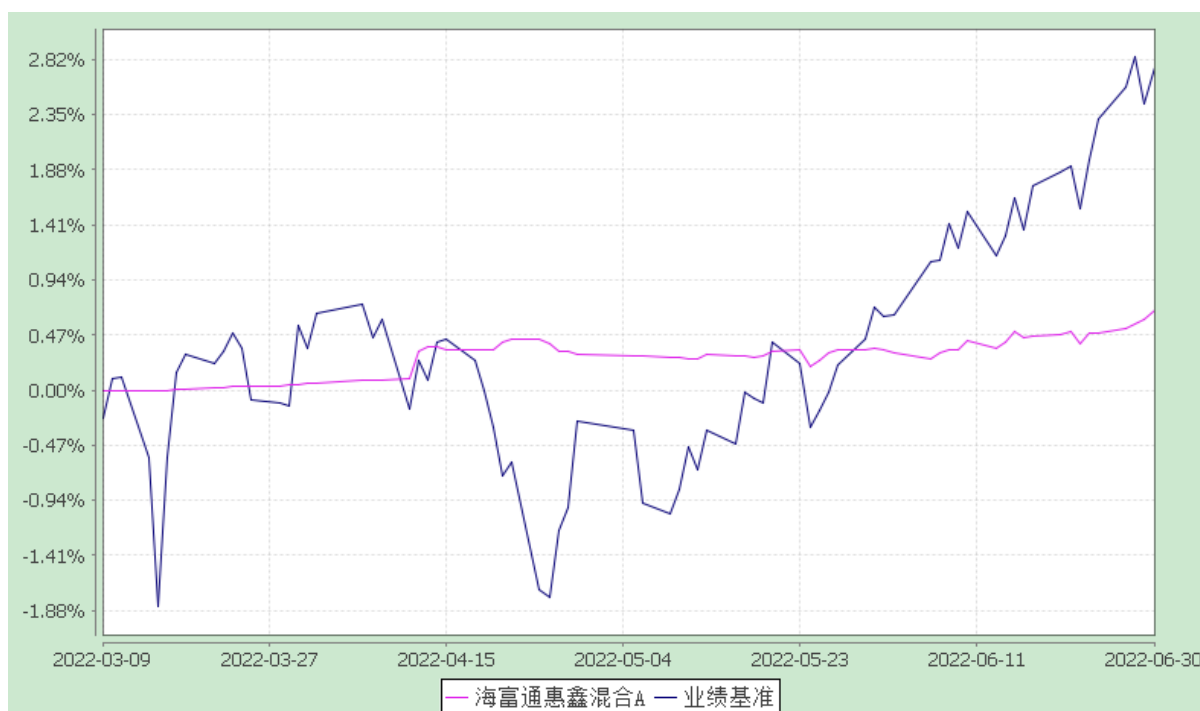
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通惠鑫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

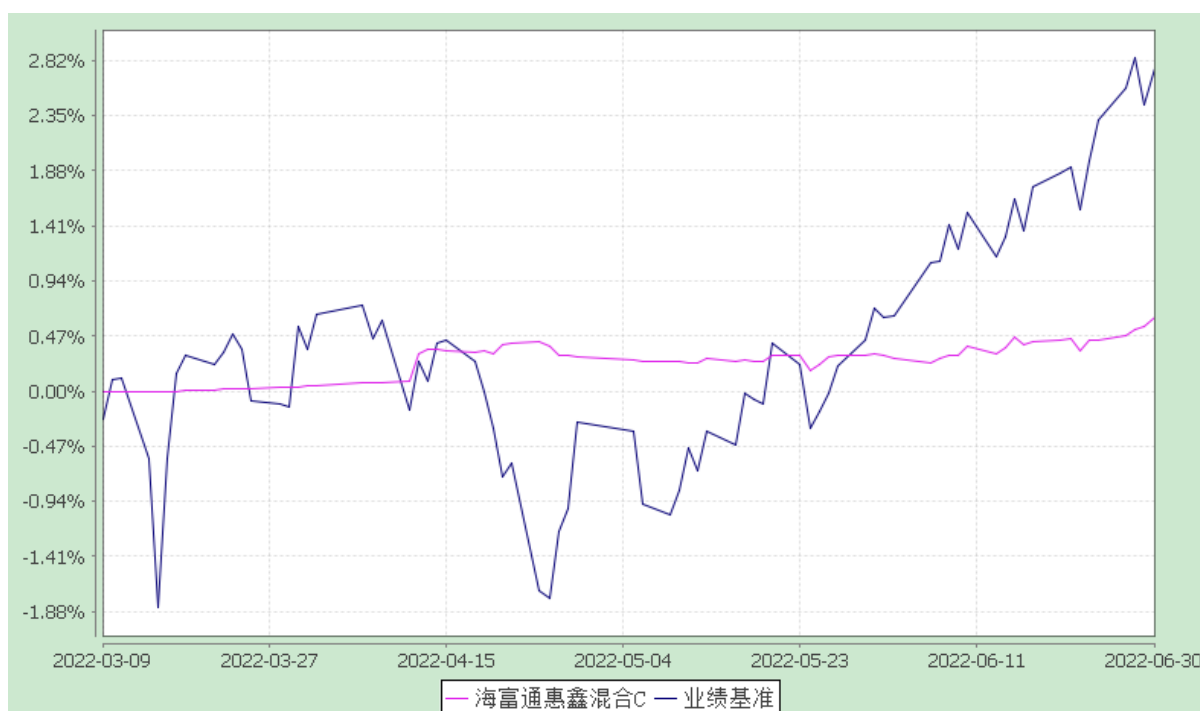
1. 海富通惠鑫混合 A

(2022 年 3 月 9 日至 2022 年 6 月 30 日)



2. 海富通惠鑫混合 C

(2022 年 3 月 9 日至 2022 年 6 月 30 日)



注：1、本基金合同于 2022 年 3 月 9 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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|----------|-------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 谈云飞 | 本基金的基金经理 | 2022-03-09 | - | 17 年 | <p>硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 4 月至 2014 年 6 月就职于华宝兴业基金管理有限公司，曾任产品经理、研究员、专户投资经理、基金经理助理，2014 年 6 月加入海富通基金管理有限公司。2014 年 7 月至 2015 年 10 月任海富通现金管理货币基金经理。2014 年 9 月至 2020 年 9 月任海富通季季增利理财债券基金经理。2015 年 1 月起兼任海富通稳健添利债券基金经理。2015 年 4 月至 2020 年 1 月兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年 2 月起兼任海富通货币基金经理。2016 年 4 月至 2017 年 6 月兼任海富通纯债债券、海富通双福债券（原海富通双福分级债券）、海富通双利债券基金经理。2016 年 4 月至 2020 年 1 月兼任海富通安颐收益混合（原海富通养老收益混合）基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通聚利债券基金经理。2016 年 9 月至 2020 年 1 月兼任海富通欣荣混合基金经理。2016 年 9 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合基金经理。2017 年 2 月至 2021 年 10 月兼任海富通强化回报混合</p> |

| | | | | | |
|-----|-----------------|------------|---|------|--|
| | | | | | <p>基金经理。2017 年 3 月起兼任海富通欣享混合基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 7 月至 2020 年 9 月任海富通季季通利理财债券基金经理。2019 年 9 月起兼任海富通中短债债券基金经理。2021 年 2 月起兼任海富通惠睿精选混合基金经理。2022 年 3 月起兼任海富通惠鑫混合、海富通欣润混合基金经理。2022 年 5 月起兼任海富通恒益一年定开债券发起式基金经理。</p> |
| 陶敏 | 本基金的基金经理 | 2022-05-06 | - | 15 年 | <p>硕士，持有基金从业人员资格证书。2004 年 7 月至 2008 年 8 月任华泰柏瑞基金管理有限公司基金清算与注册登记经理，2010 年 7 月至 2015 年 7 月任光大保德信基金管理有限公司行业研究员和策略研究员。2015 年 7 月加入海富通基金管理有限公司，历任权益投资部行业研究员、周期组组长、基金经理助理。2018 年 4 月起任海富通强化回报混合的基金经理。2022 年 5 月起兼任海富通惠鑫混合基金经理。</p> |
| 王金祥 | 本基金的基金经理；研究部总监。 | 2022-03-09 | - | 18 年 | <p>硕士，持有基金从业人员资格证书。2004 年 2 月至 2005 年 5 月任东莞证券有限责任公司分析师，2005 年 6 月至 2006 年 4 月任新疆证券有限责任公司分析师，2006 年 5 月至 2009 年 9 月任兴业证券股份有限公司研发中心行业二部副经理。2009 年 9 月加入海富通基金管理有限公司，历任股票分析师、高级股票分析师、基金经理助理、研究部总监。现任海富通基金管理有限</p> |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 公司研究部总监。2018 年 11 月至 2020 年 10 月任海富通风格优势混合基金经理。2019 年 1 月起兼任海富通研究精选混合基金经理。2022 年 3 月起兼任海富通惠鑫混合、海富通欣润混合基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度，国内经济经历了比较大的波动。随着 3 月底上海因疫情全城静默管理，叠加深圳、北京等多处突发疫情管控，对经济造成了较大的冲击，特别是长三角地区聚集的制造业，例如汽车行业，供需两端都受到较大影响。但随着 5 月底上海疫情得到超预期的有效控制，国内经济也迅速进入复苏通道。叠加国家对于地产、汽车等部分行业的政策放松和支持，6 月份宏观经济数据触底反弹，整体进入修复上升通道。

自去年以来，国外一直饱受通胀压力困扰，二季度亦如此。美国 5 月份 CPI 同比增长 8.6%，为 1981 年 12 月以来的最高值。在后疫情时代消费复苏、中上游大宗商品在多年投资不足、全球产业链持续偏紧，叠加俄乌战争持续胶着，上游资源品价格高居不下。在如此高通胀下，美联储后续加息概率进一步提升，对海外市场的风险偏好有明显抑制。

二季度，在国内经济先抑制后修复、国外通胀背景下，权益市场先跌后涨，A 股指数小幅上涨，其中上证指数上涨 4.5%，沪深 300 上涨 6.21%，中证 800 上涨 5.2%，创业板指上涨 5.68%。根据申万一级行业分类，表现最好的五个行业分别是汽车、食品饮料、电力设备、美容护理、商贸零售，分别上涨 23.1%、20.2%、15.1%、14.5%、12.5%；表现最差的五个行业分别是地产、计算机、综合、环保、传媒，分别下跌 8.9%、8.0%、4.8%、4.5%、4.4%。汽车、新能源、消费等长期高景气、疫情复苏景气反转板块在上海疫情超预期控制下，成为市场反弹先锋。

回顾整个二季度的 A 股市场，4 月底以来出现一轮强劲的风险偏好修复带来的结构性行情，赛道股尤其是光伏风电、新能源车重回 C 位，尤其是传统燃油车也重新获得青睐。本轮风险偏好的回升领先于疫情见顶的时间点，也领先于美联储升息带来的压力出清。相反，市场对于连续回暖的社融和信贷数据，对于不断加码的基建政策都嗤之以鼻。稳增长主线所代表的价值风格全面跑输市场。此外，组合按 1:9 配置权益和债券，权益占比相对较低，影响了反弹的效果。基于上述原因，本组合二季度未能跑赢业绩基准。

展望下半年尤其是三季度，稳增长的效果仍然是决定市场方向的核心内因。如果三季度能显现出稳增长的良性效果，那么相关产业链个股的经营改善就是确定性的，盈利预期和估值的修复也是确定的。相反，如果三季度仍然看不到显著的稳增长的正面迹象，甚至于相反出现显著低于预期的情况，那么就要准备好应对流动性和盈利双重冲击的情形发生。

基于上述认识，本组合一方面将坚持稳增长和高股息的双线策略，另一方面提升应变交易能力，力争在控制回撤的基础上跑赢基准。

固定收益方面，2 季度受疫情影响经济增速下滑，2 季度同比增速或在 2% 左右。投资方面，制造业投资高增，在设备制造业等高科技行业方面表现出色；基建投资在专项债资金支持的情况下维持高位；地产投资受到前端拿地与新开工大幅回落的影响仍然较为低迷。消费在国内疫情反复的情况下连续两个月负增长。出口增速较 2021 年的高点出现回落，但短期仍保持一定韧性。通胀方面，猪肉价格见底回升，油价高位震荡，CPI 小幅回升；PPI 受到基数的影响同比回落。货币政策方面，2 季度流动性维持宽松，但受制于美国加息影响，政策利率并未调降，5 年期限 LPR 单边下调 15bp。此外央行上缴利润，财政部加速留抵退税均补充了流动性。财政政策方面新增专项债发行提速，2 季度发行超 2 万亿。对应债市而言，市场在短期资金面宽松的现实与中期经济反弹的预期之间博弈，导致收益率区间震荡。曲线形态上，流动性充裕，资金利率明显偏离政

策利率导致短端跟随资金面下行，收益率曲线持续陡峭化。全季来看，10 年期国债收益率累计上行 3.3bp。

信用方面，信用债资产荒再现。从供给端看，国内疫情反弹，实体融资需求大幅走弱，信贷利率走低。从需求端看，流动性维持宽松，强化了配置需求。此外，“固收+”类产品赎回冲击过去，理财与广义基金仍有配置压力；而机构可投范围在经历了一系列信用事件后也在收窄。结构性“资产荒”下，信用债收益率全面下行，处于历史 15%分位数以下的低位；信用利差呈现明显的期限分化，利差曲线较为陡峭。

本基金目前负债端不稳定，规模偏小，目前主要配置于交易所利率债，并维持较短久期。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通惠鑫混合 A 净值增长率为 0.62%，同期业绩比较基准收益率为 2.38%，基金净值跑输业绩比较基准 1.76 个百分点。海富通惠鑫混合 C 净值增长率为 0.58%，同期业绩比较基准收益率为 2.38%，基金净值跑输业绩比较基准 1.80 个百分点。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自 2022 年 4 月 12 日至 2022 年 5 月 30 日，连续三十二个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|----------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 3,053,188.00 | 6.26 |
| | 其中：股票 | 3,053,188.00 | 6.26 |
| 2 | 固定收益投资 | 38,471,444.88 | 78.83 |
| | 其中：债券 | 38,471,444.88 | 78.83 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 5,004,161.00 | 10.25 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金 | - | - |

| | | | |
|---|--------------|---------------|--------|
| | 融资产 | | |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 920,228.73 | 1.89 |
| 7 | 其他资产 | 1,355,074.30 | 2.78 |
| 8 | 合计 | 48,804,096.91 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 101,988.00 | 0.22 |
| C | 制造业 | 774,545.00 | 1.66 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 211,971.00 | 0.46 |
| E | 建筑业 | 688,975.00 | 1.48 |
| F | 批发和零售业 | 23,727.00 | 0.05 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 196,970.00 | 0.42 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 739,333.00 | 1.59 |
| K | 房地产业 | 254,740.00 | 0.55 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 60,939.00 | 0.13 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 3,053,188.00 | 6.56 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1 | 601009 | 南京银行 | 9,700 | 101,074.00 | 0.22 |
| 2 | 601658 | 邮储银行 | 17,800 | 95,942.00 | 0.21 |
| 3 | 600919 | 江苏银行 | 12,300 | 87,576.00 | 0.19 |
| 4 | 600332 | 白云山 | 2,700 | 85,293.00 | 0.18 |
| 5 | 600018 | 上港集团 | 14,600 | 85,118.00 | 0.18 |
| 6 | 600926 | 杭州银行 | 5,600 | 83,888.00 | 0.18 |
| 7 | 600970 | 中材国际 | 8,500 | 82,365.00 | 0.18 |
| 8 | 600801 | 华新水泥 | 4,200 | 81,942.00 | 0.18 |
| 9 | 600276 | 恒瑞医药 | 2,200 | 81,598.00 | 0.18 |
| 10 | 600639 | 浦东金桥 | 6,000 | 81,540.00 | 0.18 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 25,800,303.56 | 55.43 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 10,242,060.27 | 22.01 |
| | 其中：政策性金融债 | 10,242,060.27 | 22.01 |
| 4 | 企业债券 | 1,060,597.97 | 2.28 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 1,368,483.08 | 2.94 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 38,471,444.88 | 82.66 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|-------|---------|--------------|
|----|------|------|-------|---------|--------------|

| | | | | | |
|---|--------|----------|---------|---------------|-------|
| 1 | 019666 | 22 国债 01 | 124,000 | 12,539,168.77 | 26.94 |
| 2 | 019664 | 21 国债 16 | 105,400 | 10,713,511.50 | 23.02 |
| 3 | 210202 | 21 国开 02 | 100,000 | 10,242,060.27 | 22.01 |
| 4 | 019658 | 21 国债 10 | 25,000 | 2,547,623.29 | 5.47 |
| 5 | 143743 | 18 公用 04 | 10,000 | 1,060,597.97 | 2.28 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的，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。国债期货相关投资严格遵循法律法规及中国证监会的规定。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期内本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的华安转债（110067）的发行人，因不同私募资产管理计划账户间存在违规交易、债券投资风险管控不完善、未针对私募资产管理业务的主要业务人员和相关管理人员建立收入递延支付机制等违规行为，被中国证券监督管理委员会安徽监管局责令改正。

对上述证券的投资决策程序的说明：证券业整体信用水平高，且该券商为地方中型券商，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。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 19,817.55 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,335,256.75 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,355,074.30 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|----------|------------|---------------|
| 1 | 110073 | 国投转债 | 120,909.81 | 0.26 |
| 2 | 110067 | 华安转债 | 115,663.77 | 0.25 |
| 3 | 127006 | 敖东转债 | 109,265.84 | 0.23 |
| 4 | 132015 | 18 中油 EB | 104,790.27 | 0.23 |
| 5 | 113013 | 国君转债 | 104,508.62 | 0.22 |
| 6 | 113043 | 财通转债 | 80,904.42 | 0.17 |
| 7 | 128116 | 瑞达转债 | 79,800.76 | 0.17 |
| 8 | 110062 | 烽火转债 | 53,332.81 | 0.11 |
| 9 | 128074 | 游族转债 | 51,186.91 | 0.11 |
| 10 | 113021 | 中信转债 | 45,939.55 | 0.10 |
| 11 | 113033 | 利群转债 | 35,017.42 | 0.08 |
| 12 | 110045 | 海澜转债 | 28,382.56 | 0.06 |
| 13 | 113052 | 兴业转债 | 25,684.45 | 0.06 |
| 14 | 113605 | 大参转债 | 25,615.42 | 0.06 |
| 15 | 113542 | 好客转债 | 25,613.27 | 0.06 |
| 16 | 113584 | 家悦转债 | 25,201.68 | 0.05 |
| 17 | 113011 | 光大转债 | 24,456.97 | 0.05 |
| 18 | 113042 | 上银转债 | 24,167.32 | 0.05 |
| 19 | 128035 | 大族转债 | 21,435.51 | 0.05 |
| 20 | 113044 | 大秦转债 | 20,721.04 | 0.04 |
| 21 | 127024 | 盈峰转债 | 17,246.71 | 0.04 |
| 22 | 113046 | 金田转债 | 15,803.30 | 0.03 |
| 23 | 113588 | 润达转债 | 15,727.70 | 0.03 |
| 24 | 113563 | 柳药转债 | 14,771.10 | 0.03 |
| 25 | 113634 | 珀莱转债 | 13,979.48 | 0.03 |
| 26 | 123101 | 拓斯转债 | 12,323.72 | 0.03 |
| 27 | 128108 | 蓝帆转债 | 12,217.74 | 0.03 |
| 28 | 127044 | 蒙娜转债 | 10,574.98 | 0.02 |
| 29 | 123119 | 康泰转 2 | 10,458.07 | 0.02 |

| | | | | |
|----|--------|---------|-----------|------|
| 30 | 110052 | 贵广转债 | 10,457.07 | 0.02 |
| 31 | 113623 | 凤 21 转债 | 10,324.98 | 0.02 |
| 32 | 128136 | 立讯转债 | 10,295.57 | 0.02 |
| 33 | 113627 | 太平转债 | 9,892.87 | 0.02 |
| 34 | 123004 | 铁汉转债 | 9,643.60 | 0.02 |
| 35 | 123128 | 首华转债 | 9,495.82 | 0.02 |
| 36 | 113037 | 紫银转债 | 6,232.86 | 0.01 |
| 37 | 128105 | 长集转债 | 5,096.60 | 0.01 |
| 38 | 123108 | 乐普转 2 | 4,552.08 | 0.01 |
| 39 | 110047 | 山鹰转债 | 4,524.39 | 0.01 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 海富通惠鑫混合A | 海富通惠鑫混合C |
|---------------|---------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 13,757,286.64 | 229,883,744.92 |
| 本报告期基金总申购份额 | 8,547,312.14 | 50,354,105.82 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 14,884,882.81 | 241,409,006.98 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 7,419,715.97 | 38,828,843.76 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 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 | 2022/4/12-2022/4/19 | 10,000,000.00 | - | 10,000,000.00 | - | - |
| 个人 | 1 | 2022/4/20-2022/4/27 | 1,000,090.00 | - | - | 1,000,090.00 | 2.16% |
| | 2 | 2022/4/20-2022/4/27 | 1,000,045.00 | - | 1,000,045.00 | - | - |
| | 3 | 2022/4/28-2022/5/19 | - | 3,987,638.32 | 3,987,638.32 | - | - |
| | 4 | 2022/4/28-2022/5/18 | - | 1,993,819.16 | 1,993,819.16 | - | - |

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 109 只公募基金。截至 2022 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1473 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2019 年 3 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金再度被权威媒体《证券时报》授予第十四届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金和 2018 年度绝对收益明星基金。2019 年 4 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金被权威财经媒体《中国证券报》和《上海证券报》分别评选为第十六届中国基金业金牛奖——三年期开放式混合型持续优胜金牛基金和第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·灵活配置型基金奖（三年期）。同时，海富通基金管理有限公司荣获《上海证券报》第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·成长基金管理公司奖。

2020 年 3 月，由《中国证券报》主办的第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金牛进取奖”，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖项。2020 年 7 月，由《上海证券报》主办的第十七届金基金奖名单揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金基金·股票投资回报基金管理公司奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。

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

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通惠鑫混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通惠鑫混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通惠鑫混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通惠鑫混合型证券投资基金托管协议
- (五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六)法律法规及中国证监会规定的其他文件

9.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36—37 层本基金管理人办公地址。

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司
二〇二二年七月二十一日