

# 海富通科技创新混合型证券投资基金

## 2022 年中期报告

### 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十一日

## §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。本中期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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 30 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告</b> .....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 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.....	46
7.7 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.....	46
7.8 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.....	46
7.9 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.....	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
8.3 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 .....	48
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
10.2 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 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8 其他重大事件 .....	51
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>52</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>53</b>
12.1 备查文件目录 .....	53
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	53

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通科技创新混合型证券投资基金	
基金简称	海富通科技创新混合	
基金主代码	009024	
交易代码	009024	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2020 年 3 月 10 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	275,437,465.84 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通科技创新混合 A	海富通科技创新混合 C
下属分级基金的交易代码	009025	009024
报告期末下属分级基金的份额总额	176,138,738.69 份	99,298,727.15 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将积极把握科技创新的发展趋势，聚焦于具有科技创新优势的行业和企业，充分把握其投资机会，在严格控制投资组合风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金为混合型基金，股票投资及存托凭证占基金资产的比例为 60%-95%，在进行资产配置决策时，在研究宏观经济基本面、政策面、市场情绪、资金面和投资者行为等多种因素的基础上，形成对不同市场周期的预测和判断，根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况，确定股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例。 科技创新是重塑经济增长动力的源泉。本基金将积极把握科技创新的发展趋势，聚焦于具有科技创新优势的行业和企业，充分把握其投资机会，在严格控制投资组合风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的收益。同时，结合行业配置策略、个股精选策略、港股投资策略、科创板股票的投资策略、存托凭证投资策略等进行投资。
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率×10%+上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险及预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金可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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	郭明
	联系电话	021-38650788	010-66105799
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95588
传真		021-33830166	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街55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	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		杨仓兵	陈四清

## 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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期（2022年1月1日至2022年6月30日）	
	海富通科技创新混合 A	海富通科技创新混合 C
本期已实现收益	-38,054,491.56	-17,690,350.23
本期利润	-4,904,092.59	-3,646,021.88
加权平均基金份额本期利润	-0.0279	-0.0444
本期加权平均净值利润率	-2.18%	-3.53%

本期基金份额净值增长率	-0.98%	-1.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	海富通科技创新混合 A	海富通科技创新混合 C
期末可供分配利润	77,044,444.59	40,974,164.59
期末可供分配基金份额利润	0.4374	0.4126
期末基金资产净值	267,340,182.94	147,966,280.38
期末基金份额净值	1.5178	1.4901
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	海富通科技创新混合 A	海富通科技创新混合 C
基金份额累计净值增长率	51.78%	49.01%

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

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

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

### 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

海富通科技创新混合 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
过去一个月	23.36%	2.18%	10.95%	1.18%	12.41%	1.00%
过去三个月	24.40%	2.61%	7.19%	1.53%	17.21%	1.08%
过去六个月	-0.98%	2.50%	-8.09%	1.47%	7.11%	1.03%
过去一年	22.18%	2.55%	-14.56%	1.26%	36.74%	1.29%
自基金合同生效起至今	51.78%	2.38%	28.17%	1.31%	23.61%	1.07%

海富通科技创新混合 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
过去一个月	23.28%	2.18%	10.95%	1.18%	12.33%	1.00%
过去三个月	24.14%	2.61%	7.19%	1.53%	16.95%	1.08%
过去六个月	-1.37%	2.50%	-8.09%	1.47%	6.72%	1.03%
过去一年	21.21%	2.55%	-14.56%	1.26%	35.77%	1.29%
自基金合同生效起至今	49.01%	2.38%	28.17%	1.31%	20.84%	1.07%

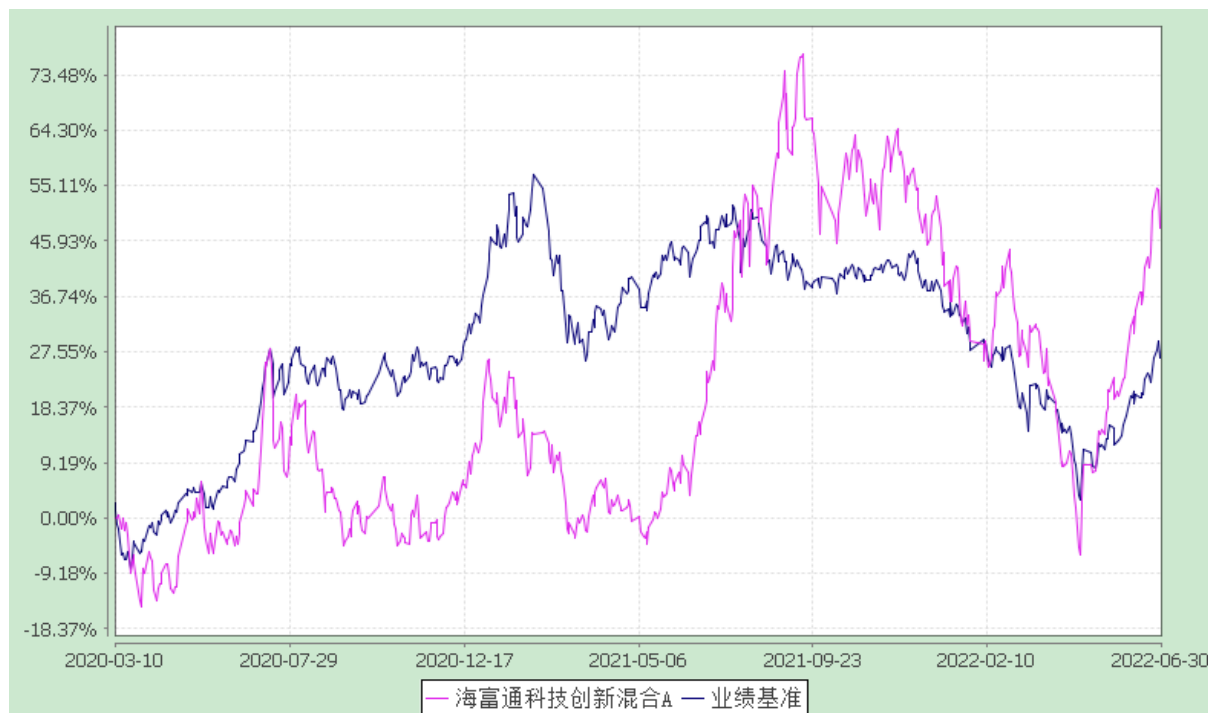
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通科技创新混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020 年 3 月 10 日至 2022 年 6 月 30 日)

海富通科技创新混合 A



海富通科技创新混合 C





注：本基金合同于 2020 年 3 月 10 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。

## §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 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 94 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）、海富通恒益金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通惠鑫混合型证券投资基金、海富通欣润混合型证券投资基金。

#### 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		
吕越超	本基金的基金经理；公募权益投资部副总	2020-03-10	-	11 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任长江证券研究所分析师，泰达宏利基金管理有限公司研究

	监。				员、基金经理。2014年11月至2016年7月任泰达宏利周期混合基金经理，2015年6月至2016年7月兼任泰达宏利创益混合基金经理。2016年11月起任海富通股票混合基金经理。2019年12月起兼任海富通先进制造股票基金经理。2020年3月起兼任海富通科技创新混合基金经理。2020年9月起兼任海富通成长甄选混合基金经理。
--	----	--	--	--	--

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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
吕越超	公募基金	4.00	4,118,755,083.15	2016/11/25
	私募资产管理计划	1.00	662,808,093.75	2022/4/27
	其他组合	1.00	5,615,733,720.08	2018/8/8
	合计	6.00	10,397,296,896.98	

注：表内任职日期为基金经理加入公司以来首次开始管理各类产品的时间。

#### 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。

#### 4.3.2 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 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

2022 年上半年，中美经济与政策周期继续错位。中国面临经济下行压力，叠加疫情的冲击，导致二季度经济出现快速下探，宏观政策迅速转向宽松，推出稳增长一揽子措施，随着疫情受控、政策发力，中国经济在 5、6 月份快速修复。海外方面，在不断的货币宽松刺激下，美国通胀水平持续抬升，俄乌冲突又进一步加剧了本就高企的通胀，同时 4 月受中国疫情冲击全球供应链受到较大影响，种种因素导致大宗商品价格暴涨，美国、欧洲通胀水平持续上升。美联储加息路径不断上修，带来美债收益率的大幅上升，全球资本市场在美联储收紧、俄乌冲突、中国疫情等冲击下出现剧烈波动。

A 股市场整体走势如同 V 字型态势，风格出现明显变化。1 月-4 月底前，逆周期、稳增长、通胀交易的相关资产表现较好，成长、消费风格的资产快速下行。随着 4 月底政治局会议明确稳增长，以及上海疫情初步得到控制、充裕的流动性发挥作用，权益市场出现大幅反弹。市场风格向成长板块明显偏移。上半年 A 股主要指数方面，上证指数下跌 6.63%，沪深 300 下跌 9.22%，中证 800 下跌 9.97%，中小综指下跌 10.77%，创业板指下跌 15.41%。分行业看，周期行业表现相对较好，煤炭上涨 31.38%，交通运输、综合、美容护理和房地产分别下跌 0.71%、1.46%、1.81% 和 2.31%；成长明显落后，电子、计算机、传媒、国防军工和环保分别下跌 24.46%、23.64%、22.25%、20.05% 和 16.42%。

从上半年市场内部的结构看，逆周期的建筑地产和通胀交易的煤炭等大宗商品交相呼应成为市场两条主线。周期主线在一季度演绎得淋漓尽致，尤其在俄乌冲突加剧全球通胀走势的背景下，与此匹配的是相关行业上半年的业绩表现。上游价格的大幅上行部分侵蚀了中下游行业的利润。成长行业内部，高景气的新能源汽车、光伏、风电等反弹幅度明显高于景气度偏弱的半导体、计算机等。消费领域的疫后复苏主线演绎非常充分，包括白酒以及航空、酒店、免税等。市场 1-4 月亏钱效应明显，5、6 月份赚钱效应明显，但前后风格差异明显。整个市场反映出宏观大变局下的产业升级高景气带来的红利，优势产业成为市场配置热点。

在上半年的操作中，本基金坚持自上而下的行业比较和自下而上的个股挖掘相结合的投资策略，逢低进一步加大了景气度较高且前期调整幅度较大的新能源、汽车方向上部分细分子行业优质公司

的挖掘力度和配置权重,同时积极自下而上寻找个股性投资机会,总体取得了较为明显的超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,海富通科技创新混合 A 净值增长率为-0.98%,同期业绩比较基准收益率为-8.09%,基金净值跑赢业绩比较基准 7.11 个百分点。海富通科技创新混合 C 净值增长率为-1.37%,同期业绩比较基准收益率为-8.09%,基金净值跑赢业绩比较基准 6.72 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

展望下半年,经济复苏态势或依然延续,但幅度可能偏弱。内需、外需均有隐忧,流动性将继续维持在相对宽松的状态。出口与制造业将逐步面临外需下行的压力,地产压力仍需更多的政策智慧解决,消费的恢复继续分化,基建将是确定性最高的支撑领域。货币政策将保持相对宽松的状态,但受制于通胀上行、内外均衡等可能难以更加宽松,但剩余流动性对 A 股依然偏正面。

下半年,回归业绩确定性,从上游到下游,从短久期到长久期。上游原材料价格压力下半年将逐步明显,中下游盈利或将改善。产业趋势变化将是权益市场的主要驱动力。经济结构变化带来的红利较为确定,电动车、光伏、风电、储能、半导体等受益于产业趋势政策导向的行业投资机会,或更加容易把握。

对于下半年的投资,本基金一方面将加大在泛新能源、重新定义汽车等景气方向上的个股挖掘力度,同时继续积极自下而上寻找基本面超预期的细分子行业和个股性投资机会,努力争取获得基金净值的良好表现。

#### 4.6 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。

#### 4.7 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，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。

#### 4.8 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 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

本报告期内，本基金的管理人——海富通基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对海富通基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：海富通科技创新混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资 产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	28,053,270.16	26,572,901.68
结算备付金		579,474.98	2,959,832.15
存出保证金		107,048.12	174,597.69
交易性金融资产	6.4.7.2	391,925,526.91	370,151,506.67
其中：股票投资		391,925,526.91	370,151,506.67
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	6,640,288.55
应收股利		-	-
应收申购款		4,441,804.64	167,576.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	3,563.95
资产总计		425,107,124.81	406,670,267.29
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,668,542.59	-
应付赎回款		5,147,301.10	1,284,322.72
应付管理人报酬		431,886.15	511,706.05
应付托管费		71,981.00	85,284.33
应付销售服务费		73,050.96	86,192.34
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	407,899.69	1,148,387.66
负债合计		9,800,661.49	3,115,893.10
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	275,437,465.84	264,495,758.72
未分配利润	6.4.7.8	139,868,997.48	139,058,615.47
净资产合计		415,306,463.32	403,554,374.19

负债和净资产总计		425,107,124.81	406,670,267.29
----------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.5178 元，C 类基金份额净值 1.4901 元。基金份额总额 275,437,465.84 份，其中 A 类基金份额 176,138,738.69 份，C 类基金份额 99,298,727.15 份。

## 6.2 利润表

会计主体：海富通科技创新混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-5,205,884.72	13,903,007.80
1.利息收入		44,145.21	55,195.19
其中：存款利息收入	6.4.7.9	44,145.21	55,195.19
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-52,653,127.63	24,739,401.55
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-53,548,469.04	24,031,056.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.12	-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	895,341.41	708,345.14
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	47,194,727.32	-11,426,641.18
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	208,370.38	535,052.24
<b>减：二、营业总支出</b>		3,344,229.75	6,177,152.77
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,440,104.26	2,833,826.30
2. 托管费	6.4.10.2.2	406,683.97	472,304.40
3. 销售服务费		408,576.48	347,582.81
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-



6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.17	88,865.04	2,523,439.26
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-8,550,114.47</b>	<b>7,725,855.03</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-8,550,114.47</b>	<b>7,725,855.03</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-8,550,114.47</b>	<b>7,725,855.03</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：海富通科技创新混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	264,495,758.72	-	139,058,615.47	403,554,374.19
二、本期期初净资产（基金净值）	264,495,758.72	-	139,058,615.47	403,554,374.19
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	10,941,707.12	-	810,382.01	11,752,089.13
（一）、综合收益总额	-	-	-8,550,114.47	-8,550,114.47
（二）、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）	10,941,707.12	-	9,360,496.48	20,302,203.60
其中：1.基金申购款	101,260,085.05	-	35,216,298.27	136,476,383.32
2.基金赎回款	-90,318,377.93	-	-25,855,801.79	-116,174,179.72
（三）、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）				
四、本期期末净资产（基金净值）	275,437,465.84	-	139,868,997.48	415,306,463.32
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	459,301,124.89	-	87,071,060.99	546,372,185.88
二、本期期初净资产（基金净值）	459,301,124.89	-	87,071,060.99	546,372,185.88
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-177,426,487.35	-	-19,628,048.43	-197,054,535.78
（一）、综合收益总额	-	-	7,725,855.03	7,725,855.03
（二）、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）	-177,426,487.35	-	-27,353,903.46	-204,780,390.81
其中：1.基金申购款	162,673,552.65	-	21,828,195.07	184,501,747.72
2.基金赎回款	-340,100,040.00	-	-49,182,098.53	-389,282,138.53
（三）、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）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	281,874,637.54	-	67,443,012.56	349,317,650.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

海富通科技创新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]67 号文《关于准予海富通科技创新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《海富通科技创新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，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 992,624,920.71 元。经向中国证监会备案，《海富通科技创新混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 3 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 992,624,920.71 份基金份额，海富通科技创新混合 A 类基金份额 850,454,163.20 份，海富通科技创新混合 C 类基金份额 142,170,757.51 份。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《海富通科技创新混合型证券投资基金基金合同》和《海富通科技创新混合型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，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/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《海富通科技创新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、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（“港股通标的股票”）、存托凭证、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、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：股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 60%-95%，投资于科技创新主题相关的股票及存托凭证占非现金基金资产的比例不低于 80%，投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0-50%；每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者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、存出保证金和应收申购款等。法律法规或监管机构日后允许本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，并可依据届时有效的法律

法规适时合理地调整投资范围。本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率×10%+上证国债指数收益率×20%。

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 8 月 30 日批准报出。

#### 6.4.2 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。

#### 6.4.3 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 6.4.2 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的要求,真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况、2022 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外,本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和 2022 年中国证监会发布的修订的《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>》。

##### (a) 新金融工具准则

根据财政部发布的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》,本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《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》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及

财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：(1) 以摊余成本计量的金融资产；(2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及 (3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的业务模式及该资产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金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。本基金未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。

#### (i) 金融工具的分类影响

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收证券清算款、应收利息和应收申购款，金额分别为人民币 26,572,901.68 元、人民币 2,959,832.15 元、人民币 174,597.69 元、人民币 6,640,288.55 元、人民币 3,563.95 元和人民币 167,576.60 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收清算款、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为人民币 26,575,055.13 元、人民币 2,961,164.05 元、人民币 174,676.29 元、人民币 6,640,288.55 元、人民币 0.00 元和人民币 167,576.60 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为人民币 370,151,506.67 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为人民币 370,151,506.67 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债，金额分别为人民币 1,284,322.72 元、人民币 511,706.05 元、人民币 85,284.33 元、人民币 86,192.34 元、人民币 973,134.03 元和人民币 175,253.63 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售

服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债，金额分别为人民币 1,284,322.72 元、人民币 511,706.05 元、人民币 85,284.33 元、人民币 86,192.34 元、人民币 973,134.03 元和人民币 175,253.63 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订的《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>》

本基金根据修订的《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>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

#### 6.4.5.2 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。

#### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2008] 1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2012] 85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2016] 36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税 [2016] 70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税 [2017] 90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

(d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	28,053,270.16
等于：本金	28,051,111.57
加：应计利息	2,158.59
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	28,053,270.16

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	316,723,476.56	-	391,925,526.91	75,202,050.35
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	316,723,476.56	-	391,925,526.91	75,202,050.35

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金于本报告期末未持有任何衍生金融资产 / 负债。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 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。

**6.4.7.5 其他资产**

本基金于本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----



	2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	678.04
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	320,441.20
其中：交易所市场	320,441.20
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
合计	407,899.69

#### 6.4.7.7 实收基金

海富通科技创新混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	180,129,229.52	180,129,229.52
本期申购	32,463,256.55	32,463,256.55
本期赎回（以“-”号填列）	-36,453,747.38	-36,453,747.38
本期末	176,138,738.69	176,138,738.69

海富通科技创新混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	84,366,529.20	84,366,529.20
本期申购	68,796,828.50	68,796,828.50
本期赎回（以“-”号填列）	-53,864,630.55	-53,864,630.55
本期末	99,298,727.15	99,298,727.15

注：此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

海富通科技创新混合 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	117,448,517.55	-21,483,779.57	95,964,737.98
本期利润	-38,054,491.56	33,150,398.97	-4,904,092.59
本期基金份额交易产生的变动数	-2,349,581.40	2,490,380.26	140,798.86
其中：基金申购款	16,199,029.02	-4,929,056.58	11,269,972.44
基金赎回款	-18,548,610.42	7,419,436.84	-11,129,173.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	77,044,444.59	14,156,999.66	91,201,444.25

海富通科技创新混合 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	53,055,660.26	-9,961,782.77	43,093,877.49
本期利润	-17,690,350.23	14,044,328.35	-3,646,021.88
本期基金份额交易产生的变动数	5,608,854.56	3,610,843.06	9,219,697.62
其中：基金申购款	31,352,457.77	-7,406,131.94	23,946,325.83
基金赎回款	-25,743,603.21	11,016,975.00	-14,726,628.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,974,164.59	7,693,388.64	48,667,553.23

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	34,530.81
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	8,365.39
其他	1,249.01
合计	44,145.21

## 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	561,100,835.73
减：卖出股票成本总额	613,246,328.87
减：交易费用	1,402,975.90
买卖股票差价收入	-53,548,469.04

**6.4.7.11 债券投资收益**

本基金本报告期内无债券投资收益。

**6.4.7.12 贵金属投资收益**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.13 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.14 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	895,341.41
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	895,341.41

**6.4.7.15 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	47,194,727.32
——股票投资	47,194,727.32
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	47,194,727.32

**6.4.7.16 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	207,655.31
基金转换费收入	715.07
合计	208,370.38

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	2,084.59
合计	88,865.04

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 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。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30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	529,701,352.55	46.12%	385,665,294.16	21.11%

#### 6.4.10.1.2 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。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的 比例
海通证券	378,682.90	51.02%	137,390.21	42.88%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的 比例
海通证券	274,325.53	22.34%	208,761.10	28.95%

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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,440,104.26	2,833,826.30
其中：支付销售机构的客户维护费	1,102,846.33	1,240,197.30

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 1.50% 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 × 1.50% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	406,683.97	472,304.40

注：支付基金托管人中国工商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。

#### 6.4.10.2.3 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		
	2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通科技创新混合 A	海富通科技创新混合 C	合计
中国工商银行	-	63,574.86	63,574.86
海通证券	-	36,051.48	36,051.48
海富通	-	1,052.61	1,052.61
合计	-	100,678.95	100,678.95
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通科技创新混合 A	海富通科技创新混合 C	合计
中国工商银行	-	34,932.20	34,932.20
海通证券	-	88,813.54	88,813.54
海富通	-	7.48	7.48
合计	-	123,753.22	123,753.22

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 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

海富通科技创新混合 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 × 0.80%/ 当年天数。

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 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。

#### 6.4.10.6 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	28,053,270.16	34,530.81	23,459,365.78	45,427.21

#### 6.4.10.7 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 2022年1月1日至2022年6月30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
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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	300933	中辰股份	公开发行	11,117	37,464.29
海通证券	688680	海优新材	公开发行	2,795	195,482.30
海通证券	300940	南极光	公开发行	3,068	39,147.68
海通证券	688687	凯因科技	公开发行	5,354	101,618.92
海通证券	688665	四方光电	公开发行	1,687	49,817.11
海通证券	688092	爱科科技	公开发行	1,137	21,728.07
海通证券	688626	翔宇医疗	公开发行	2,948	84,961.36
海通证券	688630	芯碁微装	公开发行	3,397	51,736.31
海通证券	688682	霍莱沃	公开发行	946	43,251.12
海通证券	300981	中红医疗	公开发行	2,659	129,200.81
海通证券	688217	睿昂基因	公开发行	1,040	19,156.80

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于 2022 年 6 月 30 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。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购



于 2022 年 6 月 30 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。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 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

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。

#### 6.4.13.2 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 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资和资产支持证券（2021 年 12 月 31 日：无）。

### 6.4.13.3 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。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均能及时变现。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

#### 6.4.13.3.1 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票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

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 6.4.12。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 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有流动性受限资产。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	28,053,270.16	-	-	-	28,053,270.16
结算备付金	579,474.98	-	-	-	579,474.98
存出保证金	107,048.12	-	-	-	107,048.12
交易性金融资产	-	-	-	391,925,526.91	391,925,526.91
应收申购款	2,047.00	-	-	4,439,757.64	4,441,804.64
资产总计	28,741,840.26	-	-	396,365,284.55	425,107,124.81
负债					
应付清算款	-	-	-	3,668,542.59	3,668,542.59
应付赎回款	-	-	-	5,147,301.10	5,147,301.10
应付管理人报酬	-	-	-	431,886.15	431,886.15
应付托管费	-	-	-	71,981.00	71,981.00
应付销售服务费	-	-	-	73,050.96	73,050.96
其他负债	-	-	-	407,899.69	407,899.69
负债总计	-	-	-	9,800,661.49	9,800,661.49
利率敏感度缺口	28,741,840.26	-	-	386,564,623.06	415,306,463.32
<b>上年度末</b>					
<b>2021 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	26,572,901.68	-	-	-	26,572,901.68
结算备付金	2,959,832.15	-	-	-	2,959,832.15
存出保证金	174,597.69	-	-	-	174,597.69
交易性金融资产	-	-	-	370,151,506.67	370,151,506.67
应收清算款	-	-	-	6,640,288.55	6,640,288.55
应收利息	-	-	-	3,563.95	3,563.95
应收申购款	-	-	-	167,576.60	167,576.60
资产总计	29,707,331.52	-	-	376,962,935.77	406,670,267.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,284,322.72	1,284,322.72

应付管理人报酬	-	-	-	511,706.05	511,706.05
应付托管费	-	-	-	85,284.33	85,284.33
应付销售服务费	-	-	-	86,192.34	86,192.34
其他负债	-	-	-	1,148,387.66	1,148,387.66
负债总计	-	-	-	3,115,893.10	3,115,893.10
利率敏感度缺口	29,707,331.52	-	-	373,847,042.67	403,554,374.19

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2021 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 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。本基金投资组合中股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 60%-95%，投资于科技创新主题相关的股票及存托凭证占非现金基金资产的比例不低于 80%，投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0-50%。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。

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	391,925,526. 91	94.37	370,151,506.6 7	91.72
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	391,925,526. 91	94.37	370,151,506.6 7	91.72

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	22,057,041.33	16,752,298.92
	2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-22,057,041.33	-16,752,298.92

## 6.4.14 公允价值

## 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	391,925,526.91	369,164,359.54
第二层次	-	987,147.13
第三层次	-	-
合计	391,925,526.91	370,151,506.67

##### 6.4.14.2.2 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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2021 年 12 月 31 日：无)。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具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之间无重大差异。

##### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 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	391,925,526.91	92.19
	其中：股票	391,925,526.91	92.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	28,632,745.14	6.74
8	其他各项资产	4,548,852.76	1.07
9	合计	425,107,124.81	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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	7,080,237.00	1.70
C	制造业	384,194,249.90	92.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,828.00	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	14,977.44	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	431,244.72	0.10
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	15,678.85	0.00



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	165,311.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	391,925,526.91	94.37

### 7.2.2 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。

### 7.3 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	688063	派能科技	129,528	40,438,641.60	9.74
2	603596	伯特利	267,700	21,464,186.00	5.17
3	300438	鹏辉能源	341,900	21,009,755.00	5.06
4	002756	永兴材料	127,300	19,376,333.00	4.67
5	000625	长安汽车	1,092,220	18,917,250.40	4.56
6	605117	德业股份	64,720	18,114,480.80	4.36
7	300769	德方纳米	44,240	18,080,003.20	4.35
8	002466	天齐锂业	143,000	17,846,400.00	4.30
9	000733	振华科技	101,900	13,855,343.00	3.34
10	600522	中天科技	592,900	13,695,990.00	3.30
11	603606	东方电缆	140,900	10,792,940.00	2.60
12	300750	宁德时代	20,100	10,733,400.00	2.58
13	688345	博力威	152,356	9,365,323.32	2.26
14	002472	双环传动	266,000	8,469,440.00	2.04
15	002050	三花智控	291,800	8,018,664.00	1.93
16	002074	国轩高科	167,000	7,615,200.00	1.83
17	300351	永贵电器	425,500	7,105,850.00	1.71
18	002192	融捷股份	44,300	6,808,910.00	1.64
19	601689	拓普集团	92,500	6,329,775.00	1.52
20	603297	永新光学	53,400	5,965,314.00	1.44
21	688533	上声电子	68,272	4,877,351.68	1.17
22	002340	格林美	521,500	4,745,650.00	1.14

23	688032	禾迈股份	5,111	4,451,681.00	1.07
24	600418	江淮汽车	243,800	4,183,608.00	1.01
25	600487	亨通光电	286,400	4,164,256.00	1.00
26	002897	意华股份	83,200	3,669,120.00	0.88
27	300014	亿纬锂能	36,300	3,539,250.00	0.85
28	688223	晶科能源	232,835	3,476,226.55	0.84
29	002036	联创电子	219,600	3,373,056.00	0.81
30	603997	继峰股份	310,000	3,372,800.00	0.81
31	300745	欣锐科技	63,200	3,152,416.00	0.76
32	002245	蔚蓝锂芯	132,300	3,070,683.00	0.74
33	002865	钧达股份	31,267	2,981,621.12	0.72
34	688390	固德威	9,096	2,847,138.96	0.69
35	002196	方正电机	291,000	2,840,160.00	0.68
36	002920	德赛西威	18,600	2,752,800.00	0.66
37	002240	盛新锂能	44,700	2,698,092.00	0.65
38	688707	振华新材	34,690	2,624,992.30	0.63
39	688116	天奈科技	14,881	2,522,031.88	0.61
40	600732	爱旭股份	76,200	2,516,124.00	0.61
41	688005	容百科技	18,605	2,408,231.20	0.58
42	002518	科士达	63,000	1,927,800.00	0.46
43	002824	和胜股份	33,800	1,858,662.00	0.45
44	002594	比亚迪	5,300	1,767,497.00	0.43
45	688559	海目星	22,248	1,617,429.60	0.39
46	603197	保隆科技	31,300	1,539,647.00	0.37
47	603938	三孚股份	31,140	1,539,250.20	0.37
48	002876	三利谱	37,900	1,516,758.00	0.37
49	300035	中科电气	52,600	1,470,170.00	0.35
50	688348	昱能科技	2,634	1,285,392.00	0.31
51	300305	裕兴股份	89,100	1,263,438.00	0.30
52	603078	江化微	43,650	1,247,080.50	0.30
53	002487	大金重工	28,700	1,197,651.00	0.29
54	002129	TCL 中环	18,600	1,095,354.00	0.26
55	002180	纳思达	20,700	1,047,834.00	0.25
56	605128	上海沿浦	26,600	991,382.00	0.24
57	002906	华阳集团	20,000	906,200.00	0.22
58	688187	时代电气	13,825	898,486.75	0.22
59	300114	中航电测	73,500	858,480.00	0.21
60	603982	泉峰汽车	34,900	851,211.00	0.20
61	002881	美格智能	26,060	835,483.60	0.20
62	002937	兴瑞科技	44,100	815,409.00	0.20
63	300308	中际旭创	25,100	779,355.00	0.19
64	601238	广汽集团	49,300	751,332.00	0.18
65	688598	金博股份	2,254	664,253.80	0.16
66	000408	藏格矿业	19,300	635,742.00	0.15

67	688303	大全能源	7,280	497,369.60	0.12
68	601877	正泰电器	11,800	422,204.00	0.10
69	300360	炬华科技	31,500	420,210.00	0.10
70	601702	华峰铝业	29,300	386,760.00	0.09
71	301155	海力风电	4,000	364,000.00	0.09
72	601633	长城汽车	9,500	351,880.00	0.08
73	002068	黑猫股份	24,100	336,195.00	0.08
74	300274	阳光电源	3,400	334,050.00	0.08
75	688162	巨一科技	5,330	303,863.30	0.07
76	688388	嘉元科技	3,491	296,281.17	0.07
77	300699	光威复材	5,000	294,350.00	0.07
78	301117	佳缘科技	4,900	274,057.00	0.07
79	688599	天合光能	3,371	219,957.75	0.05
80	002459	晶澳科技	2,660	209,874.00	0.05
81	300502	新易盛	8,000	209,600.00	0.05
82	000887	中鼎股份	11,200	204,288.00	0.05
83	002335	科华数据	6,600	203,610.00	0.05
84	300601	康泰生物	4,320	195,177.60	0.05
85	603799	华友钴业	1,950	186,459.00	0.04
86	601225	陕西煤业	8,700	184,266.00	0.04
87	688262	国芯科技	3,229	157,187.72	0.04
88	300432	富临精工	7,050	155,100.00	0.04
89	300919	中伟股份	1,200	148,680.00	0.04
90	300122	智飞生物	1,300	144,313.00	0.03
91	300969	恒帅股份	1,700	143,922.00	0.03
92	000681	视觉中国	8,300	118,607.00	0.03
93	002850	科达利	700	111,300.00	0.03
94	688800	瑞可达	854	107,868.74	0.03
95	600372	中航电子	5,100	98,889.00	0.02
96	600089	特变电工	3,100	84,909.00	0.02
97	603612	索通发展	2,300	84,755.00	0.02
98	603032	德新交运	1,000	79,000.00	0.02
99	300569	天能重工	6,700	77,050.00	0.02
100	300286	安科瑞	2,600	70,590.00	0.02
101	603218	日月股份	2,700	68,580.00	0.02
102	688319	欧林生物	3,412	64,452.68	0.02
103	601666	平煤股份	4,700	63,873.00	0.02
104	300568	星源材质	1,700	49,368.00	0.01
105	300413	芒果超媒	1,400	46,704.00	0.01
106	300850	新强联	440	39,173.20	0.01
107	688667	菱电电控	268	38,707.24	0.01
108	603806	福斯特	560	36,691.20	0.01
109	603876	鼎胜新材	800	36,160.00	0.01
110	688668	鼎通科技	513	36,084.42	0.01

111	688123	聚辰股份	333	35,471.16	0.01
112	002460	赣锋锂业	200	29,740.00	0.01
113	002273	水晶光电	2,300	27,853.00	0.01
114	002531	天顺风能	1,610	26,548.90	0.01
115	600821	金开新能	3,700	23,828.00	0.01
116	601677	明泰铝业	980	23,324.00	0.01
117	600256	广汇能源	2,200	23,188.00	0.01
118	603960	克来机电	1,000	20,550.00	0.00
119	002056	横店东磁	700	18,634.00	0.00
120	002139	拓邦股份	1,400	17,178.00	0.00
121	605168	三人行	145	15,678.85	0.00
122	301073	君亭酒店	216	14,977.44	0.00
123	300994	久祺股份	420	13,780.20	0.00
124	300893	松原股份	600	12,120.00	0.00
125	688075	安旭生物	68	11,900.68	0.00
126	300702	天宇股份	200	5,682.00	0.00
127	603179	新泉股份	180	5,220.00	0.00
128	300775	三角防务	100	4,815.00	0.00
129	600141	兴发集团	100	4,399.00	0.00
130	600399	抚顺特钢	100	1,790.00	0.00
131	600765	中航重机	20	643.60	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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	002466	天齐锂业	25,040,418.23	6.20
2	688063	派能科技	21,026,626.65	5.21
3	002176	江特电机	17,979,170.39	4.46
4	300769	德方纳米	17,699,502.20	4.39
5	600522	中天科技	17,057,644.00	4.23
6	000625	长安汽车	17,002,872.40	4.21
7	002192	融捷股份	16,879,594.40	4.18
8	000408	藏格矿业	16,082,507.00	3.99
9	300438	鹏辉能源	14,786,884.28	3.66
10	300750	宁德时代	14,505,303.68	3.59
11	002756	永兴材料	13,428,053.91	3.33
12	000792	盐湖股份	12,385,586.62	3.07
13	603596	伯特利	12,338,363.00	3.06
14	002240	盛新锂能	11,912,259.67	2.95

15	002738	中矿资源	11,530,532.50	2.86
16	300035	中科电气	10,718,795.00	2.66
17	603606	东方电缆	10,557,249.00	2.62
18	688345	博力威	9,296,668.26	2.30
19	300058	蓝色光标	9,215,592.00	2.28
20	688005	容百科技	8,743,455.57	2.17
21	688559	海目星	8,561,668.58	2.12

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。

#### 7.4.2 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	002756	永兴材料	30,973,547.72	7.68
2	002466	天齐锂业	28,289,152.22	7.01
3	002176	江特电机	21,757,439.25	5.39
4	000792	盐湖股份	18,164,159.48	4.50
5	000408	藏格矿业	17,449,559.44	4.32
6	002192	融捷股份	17,439,487.37	4.32
7	600499	科达制造	15,673,022.00	3.88
8	002738	中矿资源	14,077,688.60	3.49
9	603606	东方电缆	12,389,586.00	3.07
10	000681	视觉中国	12,253,512.00	3.04
11	688599	天合光能	11,686,847.56	2.90
12	600456	宝钛股份	10,101,155.57	2.50
13	300390	天华超净	9,154,682.00	2.27
14	300058	蓝色光标	8,910,499.00	2.21
15	002240	盛新锂能	8,641,954.00	2.14
16	300035	中科电气	8,543,030.00	2.12
17	600111	北方稀土	8,354,429.00	2.07
18	600522	中天科技	7,368,259.00	1.83
19	002463	沪电股份	7,261,371.40	1.80
20	002340	格林美	7,143,626.00	1.77

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。

#### 7.4.3 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	587,825,621.79
卖出股票的收入（成交）总额	561,100,835.73

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。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 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。

#### 7.8 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。

#### 7.9 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。

#### 7.10 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。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 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。

##### 7.11.2 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。

#### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的中天科技（600522），因时任董事会秘书、时任副总经理等公司工作人员在机构调研会上透露公司重要业务板块订单量和预测性数据等信息，且公司董事会秘书未勤勉尽责，未能及时发现、阻止上述行为，公司相关信息披露不公平，信息披露管理制度存在缺陷，于

2022 年 1 月 11 日上海证券交易所对其予以监管警示。因前期部分会计核算和会计处理存在差错，导致多期定期报告相关财务信息披露不准确，违反了《公开发行证券的公司信息披露编报规则第 15 号——财务报告的一般规定》、《上海证券交易所股票上市规则》等规定，2022 年 6 月 17 日上海证券交易所对江苏中天科技股份有限公司及时任财务总监予以监管警示。

对该证券的投资决策程序的说明：公司主营光纤通信和电力传输，在国内率先建成海底光缆完整生产线，拥有海底光缆制造的核心技术，旗下子公司中天科技海缆有限公司是我国第一家拥有完全自主知识产权的海底光缆厂商。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。

7.12.2 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。

### 7.12.3 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	107,048.12
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,441,804.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,548,852.76

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本期末前十名股票中未存在流通受限情况。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
海富通科技创新混合 A	10,727	16,420.13	42,966.55	0.02%	176,095,772.14	99.98%
海富通科技创新混合 C	8,277	11,996.95	14,713,896.53	14.82%	84,584,830.62	85.18%
合计	19,004	14,493.66	14,756,863.08	5.36%	260,680,602.76	94.64%

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)。

### 8.2 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	海富通科技创新混合 A	255,714.97	0.1452%
	海富通科技创新混合 C	28,150.81	0.0283%
	合计	283,865.78	0.1031%

### 8.3 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	海富通科技创新混合 A	0
	海富通科技创新混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通科技创新混合 A	10~50
	海富通科技创新混合 C	0
	合计	10~50

## §9 开放式基金份额变动

单位：份



项目	海富通科技创新混合 A	海富通科技创新混合 C
基金合同生效日（2020 年 3 月 10 日）基金份额总额	850,454,163.20	142,170,757.51
本报告期期初基金份额总额	180,129,229.52	84,366,529.20
本报告期基金总申购份额	32,463,256.55	68,796,828.50
减：本报告期基金总赎回份额	36,453,747.38	53,864,630.55
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	176,138,738.69	99,298,727.15

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 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。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金的管理人、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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	529,701,352.55	46.12%	378,682.90	51.02%	-
申万宏源	2	286,386,241.10	24.93%	121,088.44	16.31%	-

东吴证券	2	165,135,129.44	14.38%	120,486.13	16.23%	-
国联证券	2	62,088,555.46	5.41%	45,404.32	6.12%	-
中信证券	2	43,457,625.18	3.78%	31,346.79	4.22%	-
民生证券	1	30,342,289.37	2.64%	22,189.03	2.99%	-
华泰证券	1	19,707,074.63	1.72%	14,411.32	1.94%	-
广发证券	2	7,759,060.37	0.68%	5,674.48	0.76%	-
中泰证券(原齐鲁)	2	4,052,681.52	0.35%	2,963.43	0.40%	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期新增广发证券 2 个交易日单元，兴业证券 2 个交易日单元，德邦证券 2 个交易日单元，太平洋证券 2 个交易日单元，浙商证券 2 个交易日单元。

## 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。

## 10.7.2 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	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券(原齐鲁)	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 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公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	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	2022-01-04
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中邮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	2022-04-01
3	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增德邦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	2022-04-11
4	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增杭州联合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	2022-04-15
5	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加杭州联合农村商业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	2022-04-15
6	海富通基金管理有限公司关于海富通科技创新混合型证券投资基金新增诺亚正行基金销	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金	2022-04-21

	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	电子披露网站	
7	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增英大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	2022-05-17
8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增杭州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	2022-05-23
9	海富通基金管理有限公司关于终止与北京植信基金销售有限公司销售合作关系的公告	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	2022-05-30
10	海富通基金管理有限公司关于调整公募基金产品适当性风险等级划分方法的公告	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	2022-06-16

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 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”。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通科技创新混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通科技创新混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通科技创新混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通科技创新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

### 12.2 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。

### 12.3 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

二〇二二年八月三十一日