

海富通惠鑫混合型证券投资基金
2022 年第 3 季度报告
2022 年 9 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：二〇二二年十月二十六日

§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 10 月 25 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 7 月 1 日起至 9 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	50,424,268.73 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	11,181,347.50 份	39,242,921.23 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 7 月 1 日-2022 年 9 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	6,879.15	21,698.71
2.本期利润	-38,074.78	-214,549.34
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0056	-0.0079
4.期末基金资产净值	11,218,455.73	39,333,247.68
5.期末基金份额净值	1.0033	1.0023

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	-0.35%	0.07%	-2.96%	0.23%	2.61%	-0.16%
过去六个月	0.27%	0.06%	-0.65%	0.29%	0.92%	-0.23%
自基金合同生效起至今	0.33%	0.06%	-0.29%	0.34%	0.62%	-0.28%

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	-0.40%	0.07%	-2.96%	0.23%	2.56%	-0.16%
过去六个月	0.18%	0.06%	-0.65%	0.29%	0.83%	-0.23%
自基金合同生效起至今	0.23%	0.06%	-0.29%	0.34%	0.52%	-0.28%

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

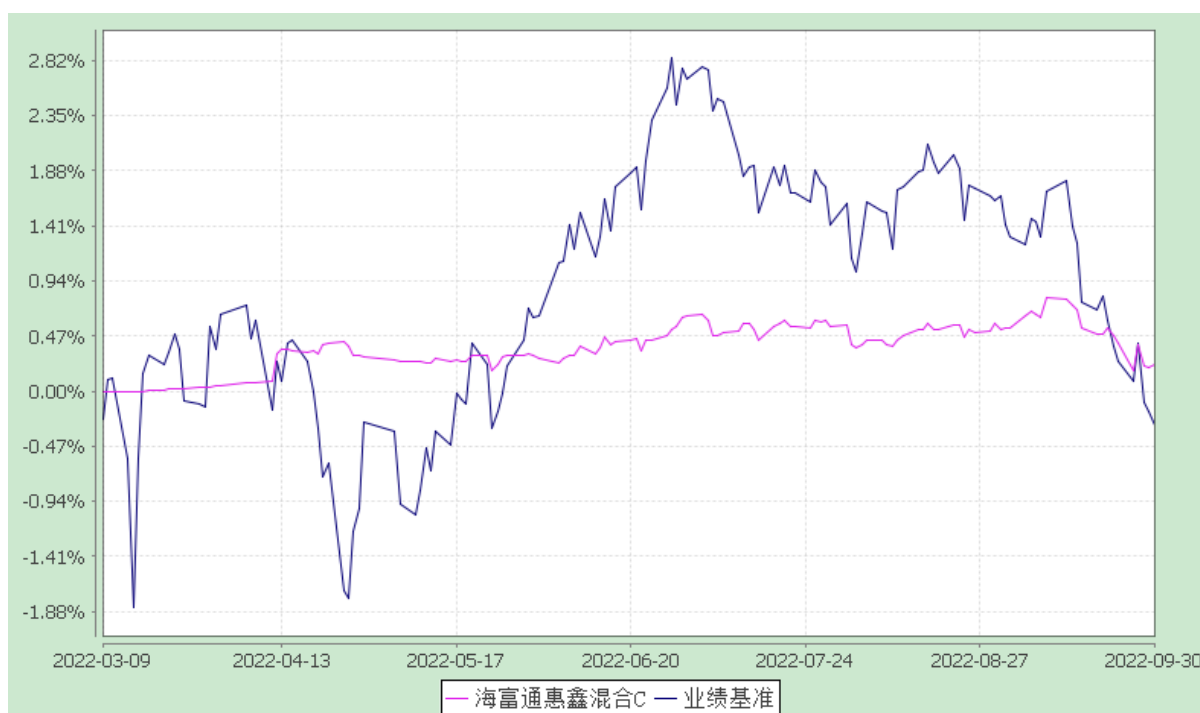
1. 海富通惠鑫混合 A

(2022 年 3 月 9 日至 2022 年 9 月 30 日)



2. 海富通惠鑫混合 C

(2022 年 3 月 9 日至 2022 年 9 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。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</p>

					理。2017 年 2 月至 2021 年 10 月兼任海富通强化回报混合基金经理。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。
陶敏	本基金的基金经理	2022-05-06	-	17 年	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。
王金祥	本基金的基金经理；研究部总监。	2022-03-09	-	18 年	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、研究副总监。现任海富通基金管理有限公司研究部总监。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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，A 股市场与全球范围内其他主要股市都经历了一轮显著的调整。以万得全 A 指数来看，当季度跌幅 12.61%。分市场看，沪深 300 指数下跌 15.16%、中证 500 指数下跌 11.47%、科创创业 50 指数下跌 16.01%、创业板综下跌 15.79%、中小综指下跌

12.93%。分行业看，申万一级行业除煤炭以外均告下跌。

三季度影响 A 股市场的主要因素来自于国内和国外两个方向。海外因素方面，最主要的拖累项来自于美联储持续大幅的加息以及地缘冲突的久拖不决。美联储本轮加息操作经历了一个由慢到快的过程且持续性显著超市场预期，尤其是美联储高官对于未来加息的指引令市场倍感压力。本轮美联储的连续加息带来了广泛的“传染”效应，一是美债收益率连续大幅上行，二是美元指数大幅超预期上行。由此，带来全球几乎所有金融资产重新定价。而地缘冲突一方面加剧了投资者对于基础能源和原材料通胀的担忧，另一方面导致欧元疲软，间接助推美元指数的强势表现。

国内因素方面，大致包括了盈利增速下滑和估值中枢下行两方面。7-8 月份市场经历了中报季的业绩大考。A 股市场的中报全市场业绩增速，营业收入同比增速为 8.40%，归母净利润同比增速为 3.30%。不论是营业收入的增速还是归母净利润的增速同比均大幅放缓。在 A 股市场估值和定价的诸因子中，业绩增速不但权重大，而且敏感度很高。这是拖累市场表现的内生性原因，也比较能说明为何国内同期利率水平一再下行，而 A 股的估值不升反降。从交易层面来看，本轮反弹结束的时点也大致同步于中报业绩披露的结束期。

三季度的市场以 8 月下旬中报季结束为分界线，之前赛道股呈现出滞胀的局面，之后则由升转跌。相对的，价值股的风格逐步启稳回升。当期，因为本组合的权益投资方面既没有在煤炭板块上重注，也没有参与地产板块的波段操作，因此未能实现正收益的目标。

展望下季度，本组合一方面将坚持稳增长和高股息高净现金的双线策略选股，另一方面积极发掘低估值转债的低风险稳定收益的机会，力争年内回归净值上升的趋势。

固定收益方面，3 季度国内经济呈现弱修复格局。投资方面，制造业投资仍有支撑，在高技术行业方面表现出色；基建投资在专项债资金与政策性金融工具的支持下维持高位；地产投资遭遇“烂尾断供”的危机模式，投资增速仍在进一步恶化。消费在面临外部冲击下修复路径并不通畅。出口增速拐点初现，但结构上仍有亮点。通胀方面，猪肉价格明显回升，油价高位震荡，在服务业价格压制下 CPI 小幅回升；PPI 受到基数的影响同比回落。货币政策方面，3 季度流动性维持宽松，央行调降 MLF 与 OMO 利率 10bp，带动 1 年期与 5 年期 LPR 利率分别调降 5bp 与 15bp。财政政策方面，地方政府专项债发行额度新增 5000 亿，政策性金融工具配套基建贷款加速落地。对应债市而言，流动性宽松与基本面偏弱支撑债市收益率向下，但随后稳增长发力与汇率的贬值压力导致收益率再度上行。全季来看，10 年期国债收益率累计下行 6bp。

信用债方面，受地产贷款风波等影响，利率大幅下行，资金成本持续低位，信用债配置力量增强，信用债收益率和利差明显压缩。地产行业仍在艰难磨底，地产债依然面临一级发行不畅、二级市场价格连锁下跌的困局，尾部风险担忧仍存。城投方面，部分城市发生信用相关负面舆情，再度引发市场对弱区域城投债的关注，政府强烈的支持意愿短期内或可提振市场对核心平台公开债券的信心，但考虑到地方政府协调资源能力有

限，中长期对于弱区域的谨慎态度预计仍将维持。

本基金目前规模偏小，目前主要配置于银行间和交易所利率债，保持中短久期。

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-0.35%，同期业绩比较基准收益率为-2.96%，基金净值跑赢业绩比较基准 2.61 个百分点。海富通惠鑫混合 C 净值增长率为-0.40%，同期业绩比较基准收益率为-2.96%，基金净值跑赢业绩比较基准 2.56 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 6 月 28 日至 2022 年 9 月 16 日，连续五十八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	5,216,319.27	10.24
	其中：股票	5,216,319.27	10.24
2	固定收益投资	40,434,243.41	79.37
	其中：债券	40,434,243.41	79.37
	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	5,002,350.72	9.82
	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	238,519.65	0.47
7	其他资产	49,799.06	0.10
8	合计	50,941,232.11	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	23,958.00	0.05
B	采矿业	281,915.00	0.56
C	制造业	2,538,730.27	5.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	263,192.00	0.52
E	建筑业	510,363.00	1.01
F	批发和零售业	86,108.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	205,033.00	0.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	178,196.00	0.35
J	金融业	794,420.00	1.57
K	房地产业	217,104.00	0.43
L	租赁和商务服务业	34,010.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	34,628.00	0.07
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	48,662.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	5,216,319.27	10.32

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	601398	工商银行	23,800	103,530.00	0.20
2	600901	江苏租赁	18,300	88,938.00	0.18

3	002352	顺丰控股	1,600	75,552.00	0.15
4	002511	中顺洁柔	7,200	73,296.00	0.14
5	600970	中材国际	8,900	73,069.00	0.14
6	601952	苏垦农发	6,300	72,450.00	0.14
7	002051	中工国际	9,400	71,628.00	0.14
8	600938	中国海油	4,200	66,486.00	0.13
9	002294	信立泰	2,700	65,961.00	0.13
10	600919	江苏银行	8,800	65,472.00	0.13

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	7,353,980.84	14.55
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,765,720.54	60.86
	其中：政策性金融债	30,765,720.54	60.86
4	企业债券	1,027,738.36	2.03
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,286,803.67	2.55
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,434,243.41	79.99

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	210202	21 国开 02	100,000	10,334,172.60	20.44
2	200305	20 进出 05	100,000	10,304,983.56	20.39
3	220303	22 进出 03	100,000	10,126,564.38	20.03
4	019656	21 国债 08	36,000	3,650,886.25	7.22
5	019666	22 国债 01	28,000	2,845,406.03	5.63

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

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	26,032.73
2	应收证券清算款	23,766.33
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	49,799.06

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	132015	18 中油 EB	210,985.15	0.42
2	127006	敖东转债	114,491.82	0.23
3	113043	财通转债	77,379.00	0.15
4	128116	瑞达转债	76,943.54	0.15
5	128108	蓝帆转债	64,247.15	0.13
6	113011	光大转债	59,791.83	0.12
7	110062	烽火转债	55,241.74	0.11
8	113033	利群转债	54,275.55	0.11
9	128074	游族转债	50,354.50	0.10
10	113013	国君转债	48,423.14	0.10
11	113021	中信转债	46,386.34	0.09

12	113584	家悦转债	36,539.52	0.07
13	110073	国投转债	34,419.24	0.07
14	110045	海澜转债	28,212.07	0.06
15	110067	华安转债	27,256.74	0.05
16	113542	好客转债	25,387.53	0.05
17	113605	大参转债	25,321.25	0.05
18	113623	凤 21 转债	25,254.66	0.05
19	113042	上银转债	24,528.72	0.05
20	113052	兴业转债	24,516.13	0.05
21	123064	万孚转债	24,366.27	0.05
22	113056	重银转债	21,919.52	0.04
23	113044	大秦转债	21,078.39	0.04
24	113627	太平转债	20,403.24	0.04
25	127024	盈峰转债	16,875.64	0.03
26	123128	首华转债	16,655.94	0.03
27	113563	柳药转债	14,372.21	0.03
28	123004	铁汉转债	9,795.92	0.02
29	113054	绿动转债	9,644.00	0.02
30	113037	紫银转债	6,245.05	0.01
31	123117	健帆转债	5,639.98	0.01
32	128105	长集转债	5,168.18	0.01
33	123108	乐普转 2	4,683.71	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	7,419,715.97	38,828,843.76
本报告期基金总申购份额	6,110,647.81	30,879,687.02

减：本报告期基金总赎回份额	2,349,016.28	30,465,609.55
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	11,181,347.50	39,242,921.23

§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

单位：份

项目	海富通惠鑫混合A	海富通惠鑫混合C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	-
本报告期买入/申购总份额	5,962,436.65	-
本报告期卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,962,436.65	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	53.32	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2022-09-16	5,962,436.65	6,001,000.00	-
合计			5,962,436.65	6,001,000.00	

注：2022年09月16日,本基金管理人运用自有资金总计600.10万元申购本基金，其中，申购费为1,000.00元。

§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	期初	申购	赎回份	持有份额	份额占

		比例达到或者超过20%的时间区间	份额	份额	额		比
机构	1	2022/9/13-2022/9/30	-	10,912,698.41	-	10,912,698.41	21.64%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；</p> <p>2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。</p> <p>3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于5000万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> <p>4、其他可能的风险。</p> <p>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。</p>							

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 9 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1380 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”。

2022 年 7 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置混合型明星基金奖”。2022 年 8 月，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”，海富通改革驱动灵活配置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”。2022 年 9 月，海富通基金管理有限公司荣获“IAMAC 推介·2021 年度保险资产管理业最受欢迎投资业务合作机构——最具进取基金公司”。

§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
二〇二二年十月二十六日